

# 博道中证 1000 指数增强型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 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:2024 年 03 月 29 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2024年3月27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2023年08月25日起至2023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	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
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	74
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	74
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	74
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	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	75

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	75
8.12 投资组合报告附注.....	75
§9 基金份额持有人信息.....	76
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
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.....	77
§10 开放式基金份额变动.....	77
§11 重大事件揭示.....	78
11.1 基金份额持有人大会决议.....	78
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.....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	78
11.4 基金投资策略的改变.....	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	78
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.....	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	79
11.8 其他重大事件.....	80
§12 备查文件目录.....	81
12.1 备查文件目录.....	81
12.2 存放地点.....	81
12.3 查阅方式.....	81

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博道中证1000指数增强型证券投资基金	
基金简称	博道中证1000指数增强	
基金主代码	017644	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年08月25日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	156,228,422.56份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道中证1000指数增强A	博道中证1000指数增强C
下属分级基金的交易代码	017644	017645
报告期末下属分级基金的份额总额	118,599,663.08份	37,628,759.48份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越标的指数的业绩表现。
投资策略	本基金以中证1000指数为标的指数，通过量化选股模型构建股票组合，首先从满足一定基本面要求的备选股票池中，综合考虑股票的估值、成长、盈利能力、营运质量、事件性因素、价量特征等因子，对股票进行综合评价后挑选符合一定标准的股票用于构建股票组合，然后利用投资组合优化工具，在控制跟踪偏离过大风险的同时，最大化组合的预期收益，以此来确定个股的投资权重。其中，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。股票组合构建完成后，本基金管理人将对组合运作绩效持续跟踪，根据市场的变化及时调整投资组合，在控制跟踪误差的基础上力求获得超越标的指数的业

	绩表现。本基金的股指期货投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证1000指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	博道基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛
	联系电话	021-80226288
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn
客户服务电话	400-085-2888	400-61-95555
传真	021-80226289	0755-83195201
注册地址	上海市虹口区东大名路1158号301室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	200122	518040
法定代表人	莫泰山	缪建民

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金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	本期2023年08月25日（基金合同生效日） - 2023年12月31日	
	博道中证1000指数 增强A	博道中证1000指数 增强C
本期已实现收益	-383,757.66	-256,205.62
本期利润	-272,382.68	-245,887.08
加权平均基金份额本期利润	-0.0016	-0.0063
本期加权平均净值利润率	-0.16%	-0.64%
本期基金份额净值增长率	-0.58%	-0.72%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末	
期末可供分配利润	-690,542.54	-270,488.99
期末可供分配基金份额利润	-0.0058	-0.0072
期末基金资产净值	117,914,280.98	37,359,533.20
期末基金份额净值	0.9942	0.9928
3.1.3 累计期末指标	2023年末	
基金份额累计净值增长率	-0.58%	-0.72%

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、本基金合同生效日为2023年08月25日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博道中证1000指数增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.41%	0.90%	-2.98%	0.98%	1.57%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-0.58%	0.87%	-1.57%	1.00%	0.99%	-0.13%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

博道中证1000指数增强C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.51%	0.90%	-2.98%	0.98%	1.47%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-0.72%	0.87%	-1.57%	1.00%	0.85%	-0.13%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

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

博道中证1000指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2023年08月25日-2023年12月31日)



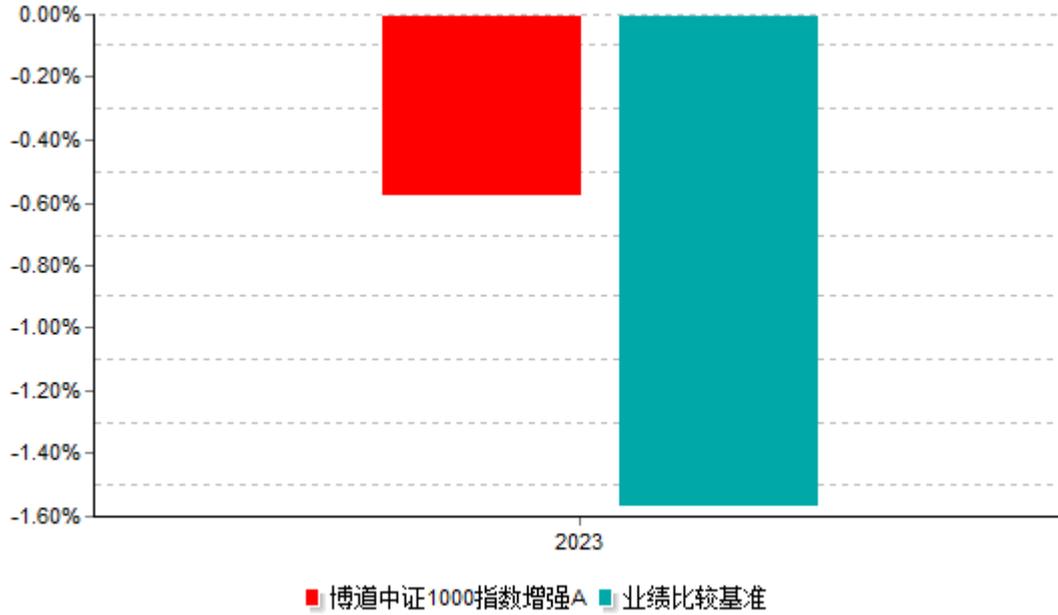
注：本基金基金合同生效日为2023年8月25日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。基金合同生效日至报告期期末，本基金尚处于建仓期，且运作时间未满一年。

博道中证1000指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2023年08月25日-2023年12月31日)

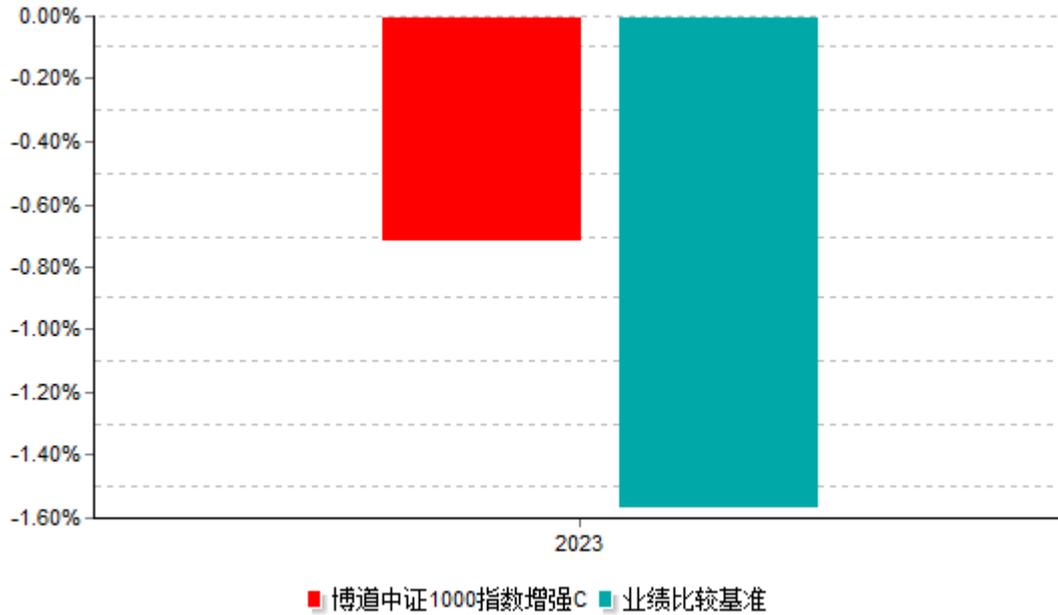


注：本基金基金合同生效日为2023年8月25日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。基金合同生效日至报告期期末，本基金尚处于建仓期，且运作时间未满一年。

### 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：基金合同生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。



注：基金合同生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博道基金管理有限公司由中国证监会证监许可[2017]822号文核准设立，于2017年6月12日成立，注册地在中国上海，注册资本为1亿元人民币。截至报告期末，公司旗下发行并管理了28只公募基金：博道启航混合型证券投资基金、博道卓远混合型证券投资基金、博道中证500指数增强型证券投资基金、博道沪深300指数增强型证券投资基金、博道远航混合型证券投资基金、博道叁佰智航股票型证券投资基金、博道志远混合型证券投资基金、博道伍佰智航股票型证券投资基金、博道嘉泰回报混合型证券投资基金、博道久航混合型证券投资基金、博道嘉瑞混合型证券投资基金、博道安远6个月持有期混合型证券投资基金、博道嘉元混合型证券投资基金、博道嘉兴一年持有期混合型证券投资基金、博道睿见一年持有期混合型证券投资基金、博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金、博道嘉丰混合型证券投资基金、博道消费智航股票型证券投资基金、博道盛彦混合型证券投资基金、博道成长智航股票型证券投资基金、博道盛兴一年持有期混合型证券投资基金、博道研究恒选混合型证券投资基金、博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金、博道惠泰优选混合型证券投资基金、博道和祥多元稳健债券型证券投资基金、博道中证1000指数增强型证券投资基金、博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金和博道红利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、博道成长智航股票、博道	2023-08-25	-	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月担任上海博道投资管

	<p>中证1000指数增强、博道红利智航股票的基金经理、量化投资部总经理、研究部副总经理</p>			<p>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、自2023年8月25日起担任博道中证1000指数增强型证券投资基金基金经理至今、自2023年10月31日起担任博道红利</p>
--	--	--	--	--

					智航股票型证券投资基金 基金经理至今。
--	--	--	--	--	------------------------

注：

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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10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，国内经济和海外流动性两大因素主导市场波动，各指数在低估区域继续弱势。全年沪深300下跌11.38%，中证500下跌7.42%，中证1000下跌6.28%，上证指数下跌3.70%，创业板指下跌19.41%，恒生指数下跌13.82%。从行业来看，通信、传媒、煤炭表现较好，分别上涨了24.78%、19.84%、13.39%，消费者服务、房地产、电力设备新能源表现较差，分别下跌41.18%、24.80%、24.65%。

从因子层面来看，2023年是个非“典型”年份，基本面类的因子全年表现都相对弱势，在传统容易有所表现的二、三季度并未录得较好超额，在容易波动的四季度反而表现相对平稳；而估值因子和量价因子因表征反转逻辑，在存量博弈的2023年持续表现亮眼。博道“指数+”系列产品在相对均衡的因子权重配置下，持续深耕底层大类因子的有效迭代，全年超额表现较好。2023年二季度开始，博道量化团队进行了AI全流程投资模型的研发，并在三季度陆续开始在各量化产品中进行运用，10月底开始，传统框架多因子模型与AI全流程多因子模型以各自约一半的权重参与博道“指数+”系列产品的实盘。

本基金成立于2023年8月25日，建仓期考虑到市场处于高性价比的投资区间，采取了快速建仓的策略，达到基准仓位后维持配置中证1000多因子选股增强模型。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金份额净值及业绩表现请见"3.1 主要会计数据和财务指标"及"3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较"部分披露。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2024年，基于赔率的视角，股市股权风险溢价再度达到2倍标准差的水平，债券市场的期限利率和信用利差也已经被压到极致；基于胜率的视角，我们监测的股票市场基本面从时间和空间的角度都已大概率接近底部。虽然很难精准预测股债资产溢价何时回归，但方向是明确的，耐心更加可贵。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023年度，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《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

无。

#### 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

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度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(2024)第26540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1000指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了博道中证1000指数增强型证券投资基金(以下简称"博道中证1000指数增强基金")的财务报表，包括2023年12月31日的资产负债表，2023年08月25日(基金合同生效日)至2023年12月31日止期间的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>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</p>

	务操作编制，公允反映了博道中证1000指数增强基金2023年12月31日的财务状况以及2023年08月25日(基金合同生效日)至2023年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	<p>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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博道中证1000指数增强基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
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	<p>博道中证1000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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估博道中证1000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1000指数增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督博道中证1000指数增强基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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</p>

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。

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：

(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。

(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。

(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。

(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，就可能对博道中证1000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1000指数增强基金不能持续经营。

(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。

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	叶尔甸、李隐煜
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	2024-03-22

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：博道中证1000指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日
<b>资产：</b>		
货币资金	7.4.7.1	2,951,009.39
结算备付金		1,014.62
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	152,846,450.05
其中：股票投资		144,732,871.97
基金投资		-
债券投资		8,113,578.08
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-

应收申购款		37,706.23
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		155,836,180.29
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		312,528.98
应付管理人报酬		136,363.46
应付托管费		20,454.53
应付销售服务费		12,606.03
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	80,413.11
负债合计		562,366.11
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.7	156,228,422.56
未分配利润	7.4.7.8	-954,608.38
净资产合计		155,273,814.18
负债和净资产总计		155,836,180.29

注：1、报告截止日2023年12月31日，A类基金份额净值0.9942元，C类基金份额净值0.9928元；基金份额总额156,228,422.56份，其中A类基金份额118,599,663.08份，C类基金份额37,628,759.48份；

2、本财务报表的实际编制期间请见“7.4.4.1 会计年度”。

## 7.2 利润表

会计主体：博道中证1000指数增强型证券投资基金

本报告期：2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年08月25日（基金合同 生效日）至2023年12月31 日
<b>一、营业总收入</b>		448,621.41
1.利息收入		24,236.88
其中：存款利息收入	7.4.7.9	14,409.36
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		9,827.52
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		139,013.62
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-32,720.33
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	61,423.87
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.13	-
股利收益	7.4.7.14	110,310.08
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	121,693.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	163,677.39
<b>减：二、营业总支出</b>		966,891.17
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	722,346.40

2.托管费	7.4.10.2.2	108,351.96
3.销售服务费		54,401.74
4.投资顾问费		-
5.利息支出		900.15
其中：卖出回购金融资产支出		900.15
6.信用减值损失		-
7.税金及附加		-
8.其他费用	7.4.7.17	80,890.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-518,269.76
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-518,269.76
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-518,269.76

### 7.3 净资产变动表

会计主体：博道中证1000指数增强型证券投资基金

本报告期：2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	222,587,383.61	-	222,587,383.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-66,358,961.05	-954,608.38	-67,313,569.43
（一）、综合收益总额	-	-518,269.76	-518,269.76
（二）、本期基金	-66,358,961.05	-436,338.62	-66,795,299.67

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	1,553,495.35	-38,687.84	1,514,807.51
2.基金赎回款	-67,912,456.40	-397,650.78	-68,310,107.18
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	156,228,422.56	-954,608.38	155,273,814.18

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1000指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]3054号《关于准予博道中证1000指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由博道基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币222,517,962.55元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2023）第0444号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》于2023年8月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为222,587,383.61份基金份额，其中认购资金利息折合69,421.06份基金份额。本基金的基金管理人为博道基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《博道中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》和《博道中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金两类基金份额分别设置代码，分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票（含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为中证1000指数收益率×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2024年3月22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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博道中证1000指数增强型证券投资基金

基金合同》和在财务报表附注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2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31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12月31日的财务状况以及2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日止期间的经营成果和净资产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。本期财务报表的实际编制期间为2023年08月25日(基金合同生效日)至2023年12月31日。

#### 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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有

的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失

计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额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相关交易费用及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确认。

以摊余成本计量的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净资产转出。

#### 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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日
活期存款	1,492,353.77
等于：本金	1,492,193.75
加：应计利息	160.02
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	1,458,655.62
等于：本金	1,458,449.05
加：应计利息	206.57
减：坏账准备	-
合计	2,951,009.39

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 2023年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	144,605,098.45	-	144,732,871.97	127,773.52	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,006,880.00	112,778.08	8,113,578.08	-6,080.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,006,880.00	112,778.08	8,113,578.08	-6,080.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	152,611,978.45	112,778.08	152,846,450.05	121,693.52	

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。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

**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**

无。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无。

**7.4.7.5 其他资产**

无。

**7.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	413.11
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	30,000.00
预提费用-信息披露费	50,000.00
合计	80,413.11

**7.4.7.7 实收基金****7.4.7.7.1 博道中证1000指数增强A**

金额单位：人民币元

项目 (博道中证1000指数增强A)	本期 2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	183,043,218.65	183,043,218.65

本期申购	497,785.49	497,785.49
本期赎回（以“-”号填列）	-64,941,341.06	-64,941,341.06
本期末	118,599,663.08	118,599,663.08

#### 7.4.7.7.2 博道中证1000指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (博道中证1000指数增强C)	本期 2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	39,544,164.96	39,544,164.96
本期申购	1,055,709.86	1,055,709.86
本期赎回（以“-”号填列）	-2,971,115.34	-2,971,115.34
本期末	37,628,759.48	37,628,759.48

注：

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；
- 3、本基金自2023年06月01日至2023年08月23日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币222,517,962.55元，折合为222,517,962.55份基金份额（其中A类基金份额182,998,243.15份，C类基金份额39,519,719.40份）。根据《博道中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币69,421.06元，折合为69,421.06份基金份额（其中A类基金份额44,975.50份，C类基金份额24,445.56份），划入基金份额持有人账户；
- 4、根据《博道中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》、《博道中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书》及《博道基金管理有限公司关于博道中证1000指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于2023年08月25日(基金合同生效日)至2023年11月23日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务、转换业务和定期定额投资业务自2023年11月24日起开始办理。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 博道中证1000指数增强A

单位：人民币元

项目 (博道中证1000指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-383,757.66	111,374.98	-272,382.68
本期基金份额交易产生的变动数	-306,784.88	-106,214.54	-412,999.42
其中：基金申购款	-1,354.84	-13,413.08	-14,767.92
基金赎回款	-305,430.04	-92,801.46	-398,231.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-690,542.54	5,160.44	-685,382.10

## 7.4.7.8.2 博道中证1000指数增强C

单位：人民币元

项目 (博道中证1000指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-256,205.62	10,318.54	-245,887.08
本期基金份额交易产生的变动数	-14,283.37	-9,055.83	-23,339.20
其中：基金申购款	-2,807.10	-21,112.82	-23,919.92
基金赎回款	-11,476.27	12,056.99	580.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-270,488.99	1,262.71	-269,226.28

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31

	日
活期存款利息收入	9,387.63
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	5,017.11
结算备付金利息收入	4.62
其他	-
合计	14,409.36

#### 7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出股票成交总额	738,851,345.78
减：卖出股票成本总额	737,890,133.95
减：交易费用	993,932.16
买卖股票差价收入	-32,720.33

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	64,071.54
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,647.67
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	61,423.87
----	-----------

#### 7.4.7.11.2 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08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,813,729.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,787,204.00
减：应计利息总额	29,157.00
减：交易费用	15.67
买卖债券差价收入	-2,647.67

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	110,310.08
基金投资产生的股利收益	-
合计	110,310.08

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1.交易性金融资产	121,693.52
——股票投资	127,773.52
——债券投资	-6,080.00
——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	121,693.52

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金赎回费收入	163,677.39
合计	163,677.39

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。

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	30,000.00
信息披露费	50,000.00
汇划手续费	490.92
开户费	400.00
合计	80,890.92

#### 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
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

无。

**7.4.10.1.2 权证交易**

无。

**7.4.10.1.3 债券交易**

无。

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

无。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**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 2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	722,346.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	238,590.44
应支付基金管理人的净管理费	483,755.96

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

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	108,351.96

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

## 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 2023年08月25日（基金合同生效日）至2023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1000指数增强A	博道中证1000指数增强C	合计
博道基金管理有限公司	0.00	43,418.12	43,418.12
合计	0.00	43,418.12	43,418.12

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日基金销售服务费=前一日C类基金份额对应的基金资产净值×0.40%/当年天数。

## 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

无。

## 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1000指数增强A

份额单位：份

项目	本期 2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金合同生效日（2023年08月25日）持有的基金份额	22,000,050.08
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	22,000,050.08

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	18.55%
---------------------	--------

博道中证1000指数增强C

份额单位：份

项目	本期 2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金合同生效日（2023年08月25日）持有的基金份额	1,000,725.00
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	1,000,725.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.66%

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大于100万份。

#### 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 2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	1,492,353.77	9,387.63

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**

无。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

无。

**7.4.12 期末（2023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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301526	国际复材	2023-12-19	6个月以上	创业板打新限售	2.66	4.45	2,733	7,269.78	12,161.85	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月以上	创业板打新限售	8.90	22.14	472	4,200.80	10,450.08	-
301516	中远通	2023-12-01	6个月以上	创业板打新限售	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
688652	京仪装备	2023-11-22	6个月以上	科创板打新限售	31.95	52.25	176	5,623.20	9,196.00	-
3014	安培	2023-	6个	创业	33.25	58.19	143	4,75	8,32	-

13	龙	12-11	月以上	板打新限售				4.75	1.17	
688653	康希通信	2023-11-10	6个月以上	科创板打新限售	10.50	15.99	516	5,418.00	8,250.84	-
688720	艾森股份	2023-11-29	6个月以上	科创板打新限售	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
301508	中机认检	2023-11-23	6个月以上	创业板打新限售	16.82	26.68	305	5,130.10	8,137.40	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	6个月以上	创业板打新限售	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301489	思泉新材	2023-10-16	6个月以上	创业板打新限售	41.66	64.11	113	4,707.58	7,244.43	-
301568	思泰克	2023-11-21	6个月以上	创业板打新限售	23.23	35.58	194	4,506.62	6,902.52	-
688648	中邮科技	2023-11-06	6个月以上	科创板打新限售	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6个月以上	创业板打新限售	31.90	39.84	151	4,816.90	6,015.84	-

				售						
301578	辰奕智能	2023-12-21	6个月以上	创业板打新限售	48.94	68.32	88	4,306.72	6,012.16	-
601096	宏盛华源	2023-12-15	6个月以上	主板打新限售	1.70	4.06	1,313	2,232.10	5,330.78	-
001378	德冠新材	2023-10-23	6个月以上	主板打新限售	31.68	31.27	146	4,625.28	4,565.42	-
001326	联域股份	2023-11-01	6个月以上	主板打新限售	41.18	48.64	84	3,459.12	4,085.76	-
601083	锦江航运	2023-11-28	6个月以上	主板打新限售	11.25	11.07	356	4,005.00	3,940.92	-
001239	永达股份	2023-12-04	6个月以上	主板打新限售	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
603273	天元智能	2023-10-16	6个月以上	主板打新限售	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
001306	夏厦精密	2023-11-09	6个月以上	主板打新限售	53.63	75.36	43	2,306.09	3,240.48	-
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6个月以上	主板打新限售	16.80	31.19	93	1,562.40	2,900.67	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6个月以上	主板打新限售	14.23	18.19	153	2,177.19	2,783.07	-
6030	麦加	2023-	6个	主板	58.08	57.81	46	2,67	2,65	-

62	芯彩	10-31	月以上	打新限售				1.68	9.26	
603373	安邦护卫	2023-12-13	6个月以上	主板打新限售	19.10	34.75	75	1,432.50	2,606.25	-
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6个月以上	主板打新限售	21.29	21.53	83	1,767.07	1,786.99	-

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

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 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

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 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，其他存款存放于东方证券股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2023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。

#### 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2023年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即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期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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注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2023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0.10%。

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155,367,786.14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 2023年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	2,951,009.39	-	-	-	-	-	2,951,009.39
结算备付金	1,014.62	-	-	-	-	-	1,014.62
交易性金融资产	-	-	8,113,578.08	-	-	144,732,871.97	152,846,450.05
应收申购款	-	-	-	-	-	37,706.23	37,706.23
资产总计	2,952,024.01	-	8,113,578.08	-	-	144,770,578.20	155,836,180.29
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	312,528.98	312,528.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	136,363.46	136,363.46
应付托管费	-	-	-	-	-	20,454.53	20,454.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-	12,606.03	12,606.03
其他负债	-	-	-	-	-	80,413.11	80,413.11
负债总计	-	-	-	-	-	562,366.11	562,366.11
利率敏感度缺口	2,952,024.01	-	8,113,578.08	-	-	144,208,212.09	155,273,814.18

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023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净资产的比例为5.23%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

#### 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。

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

本基金通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金主要投资于股票，股票资产在基金资产总值的比例不低于90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 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 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净

		值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	144,732,871.97	93.21
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	144,732,871.97	93.21

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证1000指数收益率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2023年12月31日
	1.中证1000指数收益率上升5%	7,182,730.34
	2.中证1000指数收益率下降5%	-7,182,730.34

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日
第一层次	144,577,787.05
第二层次	8,113,578.08
第三层次	155,084.92
合计	152,846,450.05

## 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

## 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

## 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年08月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	99,440.42	99,440.42
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	55,644.50	55,644.50
其中：计入损益的利得或损失	-	55,644.50	55,644.50

计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	155,084.92	155,084.92
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	55,644.50	55,644.50

注：1.于本报告期末，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资；

2.计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期内股票投资	155,084.92	平均价格亚式期权模型	预期波动率	55.12%-219.88%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §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	144,732,871.97	92.88
	其中：股票	144,732,871.97	92.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,113,578.08	5.21
	其中：债券	8,113,578.08	5.21
	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	2,952,024.01	1.89
8	其他各项资产	37,706.23	0.02
9	合计	155,836,180.29	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	2,818,256.00	1.82
C	制造业	83,778,600.52	53.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,808,490.00	1.16
E	建筑业	2,185,606.00	1.41
F	批发和零售业	2,311,907.00	1.49
G	交通运输、仓储和邮政业	2,385,181.00	1.54
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,326,206.96	9.87
J	金融业	2,495,863.00	1.61
K	房地产业	1,339,070.00	0.86
L	租赁和商务服务业	1,204,332.00	0.78
M	科学研究和技术服务业	3,656,029.60	2.35
N	水利、环境和公共设施管理业	1,781,583.00	1.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	77,265.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	2,696,054.00	1.74
S	综合	-	-
	合计	123,864,444.08	79.77

### 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	-	-
C	制造业	16,254,201.82	10.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	586,558.00	0.38
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	253,866.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	461,956.92	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,499,305.00	1.61
J	金融业	371,771.00	0.24
K	房地产业	166,124.00	0.11

L	租赁和商务服务业	31,449.75	0.02
M	科学研究和技术服务业	151,665.40	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	91,530.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	20,868,427.89	13.44

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 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	300638	广和通	70,000	1,332,100.00	0.86
2	688083	中望软件	12,921	1,286,156.34	0.83
3	002541	鸿路钢构	59,000	1,282,070.00	0.83
4	000650	仁和药业	187,900	1,245,777.00	0.80
5	603008	喜临门	70,700	1,202,607.00	0.77
6	600602	云赛智联	103,400	1,196,338.00	0.77
7	002206	海利得	236,000	1,184,720.00	0.76
8	603989	艾华集团	54,900	1,181,448.00	0.76
9	600216	浙江医药	109,600	1,176,008.00	0.76
10	002649	博彦科技	95,200	1,168,104.00	0.75
11	301080	百普赛斯	19,700	1,161,118.00	0.75

12	300973	立高食品	23,900	1,160,345.00	0.75
13	603093	南华期货	96,200	1,154,400.00	0.74
14	000597	东北制药	214,000	1,144,900.00	0.74
15	300687	赛意信息	52,000	1,132,560.00	0.73
16	000951	中国重汽	84,500	1,128,920.00	0.73
17	001696	宗申动力	168,800	1,119,144.00	0.72
18	002139	拓邦股份	114,400	1,116,544.00	0.72
19	605376	博迁新材	39,100	1,102,620.00	0.71
20	688007	光峰科技	41,800	1,081,784.00	0.70
21	002967	广电计量	70,000	1,050,700.00	0.68
22	301087	可孚医疗	26,900	1,019,510.00	0.66
23	600556	天下秀	170,600	1,008,246.00	0.65
24	603533	掌阅科技	49,800	990,024.00	0.64
25	000555	神州信息	87,600	989,004.00	0.64
26	688018	乐鑫科技	9,600	988,320.00	0.64
27	002961	瑞达期货	65,900	981,910.00	0.63
28	300768	迪普科技	65,800	972,524.00	0.63
29	600572	康恩贝	192,100	970,105.00	0.62
30	603236	移远通信	18,000	967,500.00	0.62
31	603298	杭叉集团	38,669	962,084.72	0.62
32	002283	天润工业	159,400	932,490.00	0.60
33	000737	北方铜业	159,900	927,420.00	0.60
34	002724	海洋王	108,600	892,692.00	0.57
35	600623	华谊集团	136,900	881,636.00	0.57
36	600480	凌云股份	96,000	874,560.00	0.56
37	603197	保隆科技	15,300	862,920.00	0.56
38	002706	良信股份	97,500	860,925.00	0.55
39	002402	和而泰	59,200	845,968.00	0.54
40	605338	巴比食品	38,796	833,338.08	0.54
41	000035	中国天楹	168,400	831,896.00	0.54
42	300109	新开源	45,700	824,428.00	0.53

43	000403	派林生物	29,800	811,752.00	0.52
44	603010	万盛股份	73,200	789,828.00	0.51
45	300303	聚飞光电	131,300	778,609.00	0.50
46	002891	中宠股份	29,300	772,055.00	0.50
47	600997	开滦股份	100,400	766,052.00	0.49
48	002245	蔚蓝锂芯	89,400	761,688.00	0.49
49	688209	英集芯	41,649	743,851.14	0.48
50	002705	新宝股份	51,000	743,070.00	0.48
51	603055	台华新材	60,700	730,828.00	0.47
52	603678	火炬电子	27,300	722,631.00	0.47
53	002171	楚江新材	96,100	718,828.00	0.46
54	002091	江苏国泰	91,700	718,011.00	0.46
55	600363	联创光电	20,900	710,600.00	0.46
56	002946	新乳业	61,200	702,576.00	0.45
57	002537	海联金汇	104,300	694,638.00	0.45
58	300348	长亮科技	66,800	688,708.00	0.44
59	600882	妙可蓝多	42,300	679,761.00	0.44
60	600595	中孚实业	195,300	679,644.00	0.44
61	002838	道恩股份	53,000	678,930.00	0.44
62	000902	新洋丰	58,700	668,593.00	0.43
63	300233	金城医药	39,900	664,734.00	0.43
64	603983	丸美股份	26,300	664,601.00	0.43
65	300685	艾德生物	30,200	663,796.00	0.43
66	603920	世运电路	36,100	659,908.00	0.42
67	603876	鼎胜新材	52,600	659,078.00	0.42
68	002978	安宁股份	20,800	658,528.00	0.42
69	603713	密尔克卫	12,300	654,483.00	0.42
70	601137	博威合金	41,800	649,154.00	0.42
71	000528	柳工	94,400	636,256.00	0.41
72	002516	旷达科技	128,600	633,998.00	0.41
73	603609	禾丰股份	74,000	633,440.00	0.41

74	601019	山东出版	66,700	625,646.00	0.40
75	300747	锐科激光	26,500	623,545.00	0.40
76	600409	三友化工	113,000	620,370.00	0.40
77	000681	视觉中国	41,700	612,990.00	0.39
78	600507	方大特钢	132,500	610,825.00	0.39
79	002416	爱施德	65,400	607,566.00	0.39
80	300377	赢时胜	78,000	605,280.00	0.39
81	002866	传艺科技	28,300	600,526.00	0.39
82	600138	中青旅	56,400	598,968.00	0.39
83	002390	信邦制药	133,900	594,516.00	0.38
84	002034	旺能环境	38,600	588,650.00	0.38
85	002254	泰和新材	39,300	587,928.00	0.38
86	003012	东鹏控股	70,900	584,925.00	0.38
87	600007	中国国贸	29,800	577,524.00	0.37
88	600284	浦东建设	91,600	577,080.00	0.37
89	601567	三星医疗	28,100	576,050.00	0.37
90	002212	天融信	58,400	571,152.00	0.37
91	600312	平高电气	44,500	564,705.00	0.36
92	688578	艾力斯	13,248	551,911.68	0.36
93	600389	江山股份	31,700	551,580.00	0.36
94	600201	生物股份	51,100	550,347.00	0.35
95	000685	中山公用	74,800	546,788.00	0.35
96	688166	博瑞医药	15,600	546,000.00	0.35
97	688568	中科星图	10,969	538,139.14	0.35
98	000550	江铃汽车	28,100	534,743.00	0.34
99	300894	火星人	32,800	532,672.00	0.34
100	600063	皖维高新	122,700	527,610.00	0.34
101	601969	海南矿业	78,900	519,951.00	0.33
102	600787	中储股份	101,900	519,690.00	0.33
103	002646	天佑德酒	37,700	513,097.00	0.33
104	600797	浙大网新	77,200	506,432.00	0.33

105	600986	浙文互联	92,300	503,958.00	0.32
106	600740	山西焦化	99,500	501,480.00	0.32
107	605020	永和股份	19,900	497,699.00	0.32
108	603871	嘉友国际	31,200	494,832.00	0.32
109	603063	禾望电气	18,300	457,500.00	0.29
110	688033	天宜上佳	26,678	450,858.20	0.29
111	603328	依顿电子	55,100	449,065.00	0.29
112	002991	甘源食品	6,200	443,052.00	0.29
113	603530	神马电力	21,300	441,762.00	0.28
114	605333	沪光股份	21,800	433,820.00	0.28
115	002745	木林森	50,000	433,000.00	0.28
116	600285	羚锐制药	25,200	431,172.00	0.28
117	688127	蓝特光学	18,454	429,793.66	0.28
118	688696	极米科技	3,792	428,420.16	0.28
119	300674	宇信科技	26,200	426,536.00	0.27
120	603505	金石资源	15,700	426,255.00	0.27
121	601101	昊华能源	67,300	425,336.00	0.27
122	600618	氯碱化工	46,700	424,970.00	0.27
123	002130	沃尔核材	55,800	421,290.00	0.27
124	000928	中钢国际	72,200	420,926.00	0.27
125	600645	中源协和	20,600	417,562.00	0.27
126	002436	兴森科技	28,200	415,386.00	0.27
127	605123	派克新材	4,500	410,400.00	0.26
128	300613	富瀚微	9,500	403,180.00	0.26
129	601126	四方股份	28,400	402,144.00	0.26
130	000990	诚志股份	48,700	399,827.00	0.26
131	601609	金田股份	58,500	396,045.00	0.26
132	600211	西藏药业	8,100	395,280.00	0.25
133	601311	骆驼股份	49,300	394,893.00	0.25
134	000061	农产品	61,000	394,670.00	0.25
135	603985	恒润股份	15,800	392,630.00	0.25

136	002215	诺普信	47,000	388,220.00	0.25
137	600993	马应龙	16,000	386,880.00	0.25
138	002163	海南发展	42,600	386,808.00	0.25
139	600675	中华企业	122,400	385,560.00	0.25
140	688261	东微半导	4,600	384,514.00	0.25
141	300679	电连技术	9,100	377,650.00	0.24
142	002267	陕天然气	51,500	377,495.00	0.24
143	300860	锋尚文化	6,900	376,947.00	0.24
144	002773	康弘药业	20,400	376,176.00	0.24
145	301219	腾远钴业	9,500	374,015.00	0.24
146	000791	甘肃能源	66,900	372,633.00	0.24
147	301047	义翘神州	4,500	370,800.00	0.24
148	600710	苏美达	51,800	367,262.00	0.24
149	688686	奥普特	3,200	358,400.00	0.23
150	000090	天健集团	74,600	343,160.00	0.22
151	300627	华测导航	10,900	338,118.00	0.22
152	603297	永新光学	3,400	337,790.00	0.22
153	688017	绿的谐波	2,200	337,700.00	0.22
154	603766	隆鑫通用	61,400	316,824.00	0.20
155	300772	运达股份	29,000	308,560.00	0.20
156	600612	老凤祥	4,400	303,600.00	0.20
157	600888	新疆众和	41,600	301,184.00	0.19
158	000049	德赛电池	11,100	301,032.00	0.19
159	688526	科前生物	14,600	297,548.00	0.19
160	300358	楚天科技	25,300	270,710.00	0.17
161	300887	谱尼测试	22,800	269,268.00	0.17
162	600508	上海能源	19,300	267,498.00	0.17
163	002911	佛燃能源	23,000	263,580.00	0.17
164	601811	新华文轩	19,200	262,272.00	0.17
165	601921	浙版传媒	32,300	246,772.00	0.16
166	002332	仙琚制药	19,200	245,184.00	0.16

167	601677	明泰铝业	21,400	242,676.00	0.16
168	002960	青鸟消防	17,500	242,200.00	0.16
169	002023	海特高新	26,600	242,060.00	0.16
170	002051	中工国际	29,100	236,292.00	0.15
171	600577	精达股份	55,800	231,012.00	0.15
172	002048	宁波华翔	17,700	230,277.00	0.15
173	000019	深粮控股	30,200	227,708.00	0.15
174	603599	广信股份	15,600	226,200.00	0.15
175	603279	景津装备	10,200	225,522.00	0.15
176	688019	安集科技	1,400	223,664.00	0.14
177	600502	安徽建工	47,600	221,340.00	0.14
178	002675	东诚药业	11,900	218,127.00	0.14
179	688088	虹软科技	5,287	216,978.48	0.14
180	300319	麦捷科技	22,400	215,936.00	0.14
181	600717	天津港	52,400	215,364.00	0.14
182	000718	苏宁环球	82,000	212,380.00	0.14
183	600057	厦门象屿	31,400	210,694.00	0.14
184	000012	南玻A	37,600	209,432.00	0.13
185	603033	三维股份	13,000	205,530.00	0.13
186	600483	福能股份	24,700	204,269.00	0.13
187	688133	泰坦科技	4,397	203,800.95	0.13
188	603801	志邦家居	12,100	202,917.00	0.13
189	603103	横店影视	11,400	202,692.00	0.13
190	688100	威胜信息	7,000	202,440.00	0.13
191	002605	姚记科技	9,100	202,202.00	0.13
192	603439	贵州三力	10,600	200,128.00	0.13
193	002987	京北方	10,700	198,806.00	0.13
194	300653	正海生物	6,800	197,336.00	0.13
195	002194	武汉凡谷	20,000	197,200.00	0.13
196	300755	华致酒行	10,600	193,874.00	0.12
197	000923	河钢资源	11,500	193,200.00	0.12

198	603699	纽威股份	13,700	189,882.00	0.12
199	601200	上海环境	21,100	189,689.00	0.12
200	688128	中国电研	9,079	186,301.08	0.12
201	002677	浙江美大	18,300	185,013.00	0.12
202	002274	华昌化工	24,500	184,975.00	0.12
203	000811	冰轮环境	13,500	183,195.00	0.12
204	688046	药康生物	9,071	182,780.65	0.12
205	601369	陕鼓动力	22,800	181,944.00	0.12
206	300696	爱乐达	10,400	181,064.00	0.12
207	601801	皖新传媒	25,600	177,920.00	0.11
208	603588	高能环境	26,200	171,348.00	0.11
209	600158	中体产业	21,900	170,382.00	0.11
210	002467	二六三	36,100	167,504.00	0.11
211	600810	神马股份	22,400	166,656.00	0.11
212	000088	盐田港	33,900	165,432.00	0.11
213	002979	雷赛智能	7,600	163,780.00	0.11
214	688016	心脉医疗	800	155,704.00	0.10
215	601963	重庆银行	22,200	154,512.00	0.10
216	688499	利元亨	3,960	150,796.80	0.10
217	300327	中颖电子	6,420	146,376.00	0.09
218	000688	国城矿业	13,400	138,154.00	0.09
219	600123	兰花科创	12,100	133,584.00	0.09
220	600446	金证股份	11,500	133,055.00	0.09
221	002984	森麒麟	4,600	132,710.00	0.09
222	603583	捷昌驱动	6,500	130,195.00	0.08
223	000828	东莞控股	12,000	128,880.00	0.08
224	002314	南山控股	44,400	128,760.00	0.08
225	301200	大族数控	3,400	128,418.00	0.08
226	300229	拓尔思	7,600	128,136.00	0.08
227	600478	科力远	25,800	126,936.00	0.08
228	603919	金徽酒	5,100	125,562.00	0.08

229	600295	鄂尔多斯	12,800	124,160.00	0.08
230	301071	力量钻石	3,800	122,740.00	0.08
231	605222	起帆电缆	6,300	121,464.00	0.08
232	300382	斯莱克	12,200	121,146.00	0.08
233	002948	青岛银行	39,700	121,085.00	0.08
234	002043	兔宝宝	13,600	120,496.00	0.08
235	002959	小熊电器	2,300	119,439.00	0.08
236	603936	博敏电子	11,400	119,016.00	0.08
237	688001	华兴源创	3,400	118,830.00	0.08
238	603915	国茂股份	7,200	118,656.00	0.08
239	688733	壹石通	4,000	117,080.00	0.08
240	000913	钱江摩托	9,300	115,971.00	0.07
241	688048	长光华芯	1,800	112,806.00	0.07
242	605009	豪悦护理	2,900	110,693.00	0.07
243	002088	鲁阳节能	7,500	106,875.00	0.07
244	300482	万孚生物	3,500	105,595.00	0.07
245	301015	百洋医药	2,900	103,994.00	0.07
246	002158	汉钟精机	4,600	102,396.00	0.07
247	600761	安徽合力	5,600	101,976.00	0.07
248	688232	新点软件	2,800	101,360.00	0.07
249	600391	航发科技	5,200	99,424.00	0.06
250	300039	上海凯宝	14,900	99,085.00	0.06
251	688707	振华新材	4,800	98,400.00	0.06
252	002218	拓日新能	21,600	97,416.00	0.06
253	002302	西部建设	15,000	97,200.00	0.06
254	603733	仙鹤股份	6,000	96,840.00	0.06
255	688800	瑞可达	2,400	96,432.00	0.06
256	601279	英利汽车	16,500	96,195.00	0.06
257	300206	理邦仪器	9,400	95,974.00	0.06
258	002351	漫步者	5,400	95,418.00	0.06
259	000829	天音控股	9,800	93,492.00	0.06

260	000789	万年青	13,600	93,296.00	0.06
261	000682	东方电子	11,200	90,160.00	0.06
262	600125	铁龙物流	14,900	90,145.00	0.06
263	688508	芯朋微	1,800	88,578.00	0.06
264	603043	广州酒家	4,500	87,885.00	0.06
265	000901	航天科技	9,300	86,676.00	0.06
266	600210	紫江企业	18,000	84,600.00	0.05
267	002918	蒙娜丽莎	6,000	81,240.00	0.05
268	002219	新里程	25,500	77,265.00	0.05
269	603489	八方股份	1,400	76,930.00	0.05
270	600557	康缘药业	3,700	75,924.00	0.05
271	002233	塔牌集团	10,600	75,048.00	0.05
272	688598	金博股份	1,000	69,900.00	0.05
273	603128	华贸物流	9,300	68,727.00	0.04
274	002859	洁美科技	2,600	64,870.00	0.04
275	600273	嘉化能源	7,500	64,425.00	0.04
276	300068	南都电源	4,500	58,230.00	0.04
277	600971	恒源煤电	5,000	55,750.00	0.04
278	688239	航宇科技	1,000	47,770.00	0.03
279	000885	城发环境	4,200	47,628.00	0.03
280	601606	长城军工	3,700	45,066.00	0.03
281	000686	东北证券	6,200	44,020.00	0.03
282	300332	天壕能源	5,500	43,725.00	0.03
283	603323	苏农银行	9,600	39,936.00	0.03
284	002545	东方铁塔	5,400	38,610.00	0.02
285	000969	安泰科技	3,900	35,061.00	0.02
286	603171	税友股份	700	24,766.00	0.02
287	300777	中简科技	800	23,864.00	0.02
288	300596	利安隆	800	23,648.00	0.02
289	000989	九芝堂	2,200	22,264.00	0.01
290	000719	中原传媒	2,100	20,433.00	0.01

291	600649	城投控股	5,200	19,240.00	0.01
292	000006	深振业 A	3,400	15,606.00	0.01

### 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	600038	中直股份	17,100	658,863.00	0.42
2	000589	贵州轮胎	88,100	539,172.00	0.35
3	000338	潍柴动力	38,700	528,255.00	0.34
4	688300	联瑞新材	9,600	508,320.00	0.33
5	300560	中富通	27,900	494,109.00	0.32
6	688656	浩欧博	13,354	464,185.04	0.30
7	603258	电魂网络	19,000	436,620.00	0.28
8	002791	坚朗五金	10,500	425,145.00	0.27
9	300922	天秦装备	24,400	416,508.00	0.27
10	002393	力生制药	13,601	354,986.10	0.23
11	688208	道通科技	14,836	352,355.00	0.23
12	605208	永茂泰	36,800	349,600.00	0.23
13	002452	长高电新	49,000	347,900.00	0.22
14	300566	激智科技	18,400	343,712.00	0.22
15	603225	新凤鸣	24,200	343,640.00	0.22
16	002823	凯中精密	26,900	341,630.00	0.22
17	688169	石头科技	1,200	339,540.00	0.22
18	002469	三维化学	55,700	337,542.00	0.22
19	002969	嘉美包装	81,200	334,544.00	0.22
20	688687	凯因科技	9,500	331,170.00	0.21
21	605288	凯迪股份	7,000	329,840.00	0.21
22	688689	银河微电	11,801	328,893.87	0.21
23	603444	吉比特	1,300	318,656.00	0.21

24	002415	海康威视	8,800	305,536.00	0.20
25	002555	三七互娱	15,600	293,436.00	0.19
26	688510	航亚科技	15,928	280,651.36	0.18
27	300286	安科瑞	10,400	269,672.00	0.17
28	601500	通用股份	63,600	263,304.00	0.17
29	300980	祥源新材	11,000	258,060.00	0.17
30	603992	松霖科技	13,500	244,890.00	0.16
31	601398	工商银行	48,600	232,308.00	0.15
32	603507	振江股份	8,700	225,417.00	0.15
33	300987	川网传媒	12,700	225,044.00	0.14
34	002664	信质集团	13,500	224,505.00	0.14
35	605158	华达新材	29,500	224,200.00	0.14
36	002410	广联达	12,200	209,108.00	0.13
37	688580	伟思医疗	3,000	191,790.00	0.12
38	300823	建科机械	8,400	180,684.00	0.12
39	600989	宝丰能源	12,100	178,717.00	0.12
40	603579	荣泰健康	8,400	174,972.00	0.11
41	603090	宏盛股份	7,200	169,344.00	0.11
42	002927	泰永长征	10,600	166,844.00	0.11
43	002133	广宇集团	47,600	166,124.00	0.11
44	603610	麒盛科技	13,800	164,496.00	0.11
45	002624	完美世界	13,800	163,392.00	0.11
46	603486	科沃斯	3,900	161,616.00	0.10
47	002209	达意隆	14,500	159,500.00	0.10
48	603167	渤海轮渡	17,500	155,400.00	0.10
49	688049	炬芯科技	4,049	154,145.43	0.10
50	688607	康众医疗	7,500	152,850.00	0.10
51	600900	长江电力	6,400	149,376.00	0.10
52	301042	安联锐视	3,800	148,960.00	0.10
53	301526	国际复材	27,325	148,155.61	0.10
54	002687	乔治白	27,500	146,575.00	0.09

55	301235	华康医疗	5,600	143,528.00	0.09
56	301566	达利凯普	4,719	133,570.61	0.09
57	301008	宏昌科技	4,300	129,817.00	0.08
58	605169	洪通燃气	10,100	114,433.00	0.07
59	002879	长缆科技	6,900	110,538.00	0.07
60	688517	金冠电气	6,800	107,372.00	0.07
61	002938	鹏鼎控股	4,800	107,136.00	0.07
62	000429	粤高速 A	12,600	106,596.00	0.07
63	300626	华瑞股份	9,800	106,330.00	0.07
64	300857	协创数据	2,000	105,980.00	0.07
65	603833	欧派家居	1,500	104,415.00	0.07
66	002827	高争民爆	6,200	103,850.00	0.07
67	301413	安培龙	1,425	103,445.57	0.07
68	603416	信捷电气	2,700	101,412.00	0.07
69	605580	恒盛能源	8,700	101,094.00	0.07
70	000404	长虹华意	17,100	100,719.00	0.06
71	300468	四方精创	9,200	99,820.00	0.06
72	002609	捷顺科技	8,700	99,354.00	0.06
73	601288	农业银行	27,200	99,008.00	0.06
74	603601	再升科技	23,000	98,900.00	0.06
75	603916	苏博特	9,600	97,824.00	0.06
76	002557	洽洽食品	2,800	97,496.00	0.06
77	603076	乐惠国际	3,600	96,480.00	0.06
78	002384	东山精密	5,200	94,536.00	0.06
79	002462	嘉事堂	6,600	93,786.00	0.06
80	600801	华新水泥	7,500	93,225.00	0.06
81	300872	天阳科技	6,800	93,024.00	0.06
82	601098	中南传媒	9,000	91,530.00	0.06
83	601000	唐山港	26,100	91,350.00	0.06
84	002367	康力电梯	12,100	90,992.00	0.06
85	600600	青岛啤酒	1,200	89,700.00	0.06

86	003030	祖名股份	4,100	88,560.00	0.06
87	000063	中兴通讯	3,300	87,384.00	0.06
88	600774	汉商集团	8,700	85,782.00	0.06
89	000932	华菱钢铁	15,800	81,370.00	0.05
90	603048	浙江黎明	4,200	77,994.00	0.05
91	300554	三超新材	2,900	77,575.00	0.05
92	688067	爱威科技	3,200	76,192.00	0.05
93	002472	双环传动	2,900	75,458.00	0.05
94	600180	瑞茂通	12,200	74,298.00	0.05
95	603056	德邦股份	5,000	72,350.00	0.05
96	601096	宏盛华源	13,124	71,472.38	0.05
97	002479	富春环保	14,700	70,119.00	0.05
98	603045	福达合金	4,400	69,476.00	0.04
99	600979	广安爱众	19,800	68,508.00	0.04
100	002449	国星光电	7,100	67,237.00	0.04
101	300310	宜通世纪	15,100	66,742.00	0.04
102	301578	辰奕智能	874	66,691.36	0.04
103	301459	丰茂股份	1,402	64,112.28	0.04
104	688336	三生国健	2,800	63,028.00	0.04
105	000100	TCL科技	14,200	61,060.00	0.04
106	601218	吉鑫科技	13,800	55,200.00	0.04
107	000568	泸州老窖	300	53,826.00	0.03
108	603198	迎驾贡酒	800	53,032.00	0.03
109	301093	华兰股份	1,500	48,450.00	0.03
110	603080	新疆火炬	2,800	46,648.00	0.03
111	002381	双箭股份	5,900	44,722.00	0.03
112	688155	先惠技术	800	44,504.00	0.03
113	001239	永达股份	1,887	44,228.22	0.03
114	601688	华泰证券	2,900	40,455.00	0.03
115	301036	双乐股份	1,800	39,906.00	0.03
116	601368	绿城水务	6,800	36,380.00	0.02

117	300283	温州宏丰	5,500	34,980.00	0.02
118	603004	鼎龙科技	930	33,032.67	0.02
119	002352	顺丰控股	800	32,320.00	0.02
120	603373	安邦护卫	745	31,449.75	0.02
121	603365	水星家纺	1,900	27,322.00	0.02
122	603231	索宝蛋白	828	19,309.39	0.01
123	301516	中远通	604	9,368.04	0.01
124	688652	京仪装备	176	9,196.00	0.01
125	688653	康希通信	516	8,250.84	0.01
126	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.01
127	301508	中机认检	305	8,137.40	0.01
128	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
129	301489	思泉新材	113	7,244.43	0.00
130	301568	思泰克	194	6,902.52	0.00
131	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
132	001378	德冠新材	146	4,565.42	0.00
133	001326	联域股份	84	4,085.76	0.00
134	601083	锦江航运	356	3,940.92	0.00
135	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
136	001306	夏厦精密	43	3,240.48	0.00
137	603107	上海汽配	153	2,783.07	0.00
138	603062	麦加芯彩	46	2,659.26	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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	688088	虹软科技	4,520,513.72	2.91
2	000528	柳工	4,463,932.00	2.87

3	000550	江铃汽车	4,426,208.00	2.85
4	600572	康恩贝	4,351,462.00	2.80
5	300394	天孚通信	4,143,695.00	2.67
6	300674	宇信科技	4,108,675.00	2.65
7	300002	神州泰岳	3,974,558.00	2.56
8	600761	安徽合力	3,950,232.00	2.54
9	688578	艾力斯	3,943,958.51	2.54
10	688007	光峰科技	3,824,877.18	2.46
11	688033	天宜上佳	3,771,909.13	2.43
12	300638	广和通	3,587,699.00	2.31
13	688083	中望软件	3,549,811.15	2.29
14	300130	新国都	3,545,856.00	2.28
15	603920	世运电路	3,533,261.00	2.28
16	000685	中山公用	3,512,440.00	2.26
17	600480	凌云股份	3,396,576.00	2.19
18	603093	南华期货	3,392,531.00	2.18
19	300973	立高食品	3,366,257.00	2.17
20	000030	富奥股份	3,363,679.00	2.17
21	603393	新天然气	3,362,576.50	2.17
22	300303	聚飞光电	3,356,121.00	2.16
23	600587	新华医疗	3,310,342.00	2.13
24	002517	恺英网络	3,304,081.00	2.13
25	002276	万马股份	3,271,891.00	2.11
26	603008	喜临门	3,270,904.00	2.11
27	600729	重庆百货	3,225,292.00	2.08
28	002558	巨人网络	3,218,048.00	2.07
29	000921	海信家电	3,166,378.00	2.04

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300394	天孚通信	4,640,086.00	2.99
2	688088	虹软科技	4,455,240.04	2.87
3	300002	神州泰岳	4,131,484.00	2.66
4	000550	江铃汽车	3,946,248.00	2.54
5	688578	艾力斯	3,830,355.52	2.47
6	000528	柳工	3,773,003.00	2.43
7	600761	安徽合力	3,616,248.00	2.33
8	603393	新天然气	3,600,494.42	2.32
9	000030	富奥股份	3,566,854.00	2.30
10	300674	宇信科技	3,487,539.00	2.25
11	300130	新国都	3,477,295.00	2.24
12	600572	康恩贝	3,398,267.00	2.19
13	688033	天宜上佳	3,300,646.42	2.13
14	600587	新华医疗	3,299,782.00	2.13
15	002517	恺英网络	3,245,797.00	2.09
16	002276	万马股份	3,227,292.00	2.08
17	002558	巨人网络	3,146,814.00	2.03
18	688007	光峰科技	3,099,380.68	2.00
19	002583	海能达	3,082,210.00	1.99
20	300319	麦捷科技	3,077,612.00	1.98

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	882,495,232.40
卖出股票收入（成交）总额	738,851,345.78

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	8,113,578.08	5.23
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	8,113,578.08	5.23

### 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	019703	23国债10	80,000	8,113,578.08	5.23

### 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

无。

### 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

无。

### 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

无。

**8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

无。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1 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11月14日，深圳市广和通无线股份有限公司（证券代码300638）因销售未经强制性认证的移动通信模块，收到深圳市市场监督管理局南山监管局罚款50000元，没收违法所得28632元的行政处罚（深市监南处罚〔2023〕西丽164号）。

2023年7月7日，喜临门家具股份有限公司（证券代码603008）因未发布业绩预告，信息披露不及时，被浙江证监局采取出具警示函的监督管理措施，并记入证券期货市场诚信档案。

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。

**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	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	37,706.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	37,706.23
---	----	-----------

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 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

无。

##### 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

无。

#### 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 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
博道 中证1 000指 数增 强A	1,2 41	95,567.82	32,505,235.14	27.4 1%	86,094,427.94	72.59%
博道 中证1 000指 数增	2,6 27	14,323.85	31,012,808.33	82.4 2%	6,615,951.15	17.58%

强C						
合计	3,848	40,599.90	63,518,043.47	40.66%	92,710,379.09	59.34%

### 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1000指数增强A	3,389,015.39	2.86%
	博道中证1000指数增强C	40,296.52	0.11%
	合计	3,429,311.91	2.20%

### 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1000指数增强A	>100
	博道中证1000指数增强C	-
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	博道中证1000指数增强A	>100
	博道中证1000指数增强C	-
	合计	>100

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

	博道中证1000指数增强A	博道中证1000指数增强C
基金合同生效日(2023年08月25日)基金份额总额	183,043,218.65	39,544,164.96

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	497,785.49	1,055,709.86
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	64,941,341.06	2,971,115.34
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	118,599,663.08	37,628,759.48

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

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。

### 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"7.4.7.17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

#### 11.6.1 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。

#### 11.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

## 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	
东方证券	2	1,620,234,366.55	100.00%	520,563.67	100.00%	-

### 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
东方证券	15,578,656.00	100.00%	144,502,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：

- 1、报告期内，上述交易单元均为本基金新增交易单元；
- 2、基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：
  - (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
  - (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；
  - (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；
  - (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关于博道中证1000指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-26
2	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、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-09-25
3	博道基金管理有限公司关于博道中证1000指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-21
4	博道基金管理有限公司关于旗下基金开展直销转换费率优惠活动的公告	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	2023-11-24
5	博道基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔申购最低金额、单笔赎回最低份额及最低保留余额的公告	中国证券报、证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-16
6	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海华夏财富投资管理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	2023-12-27
7	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧财富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	2023-12-28

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道中证1000指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道中证1000指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道中证1000指数增强型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内博道中证1000指数增强型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

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

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

博道基金管理有限公司  
二〇二四年三月二十九日