

博道久航混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:兴业证券股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年01月01日起至2024年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	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	49
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	71
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	71
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	71
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	71
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
7.12 投资组合报告附注	71
§8 基金份额持有人信息	72
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73

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.....	73
§9 开放式基金份额变动.....	73
§10 重大事件揭示.....	74
10.1 基金份额持有人大会决议.....	74
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.....	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
10.4 基金投资策略的改变.....	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
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.....	74
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	75
10.8 其他重大事件.....	76
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
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.....	77
§12 备查文件目录.....	77
12.1 备查文件目录.....	77
12.2 存放地点.....	78
12.3 查阅方式.....	78

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道久航混合型证券投资基金	
基金简称	博道久航混合	
基金主代码	008318	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年12月24日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	兴业证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	320,782,965.51份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道久航混合A	博道久航混合C
下属分级基金的交易代码	008318	008319
报告期末下属分级基金的份额总额	150,779,197.31份	170,003,768.20份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，结合宏观基本面、指数价量特征、风险偏好、资金流向等多维度因素的分析，确定和调整资产配置比例，根据对市场环境以及股票估值、成长、盈利能力、营运质量、事件性因素、价量特征等因子表现的判断挑选个股构建股票组合，根据对利率、经济周期、宏观政策等因素的分析构建债券组合。本基金的可转换债券和可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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	兴业证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	叶文璜	李少峰
	联系电话	021-80226288	021-20370710
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	disclosure_xztg@xyzq.com.cn
客户服务电话		400-085-2888	95562
传真		021-80226289	0591-38507797
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	福建省福州市湖东路268号证券大厦
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	上海浦东新区长柳路36号兴业证券大厦11楼
邮政编码		200122	200135
法定代表人		莫泰山	杨华辉

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.bdfund.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	博道久航混合A	博道久航混合C
本期已实现收益	-2,932,331.71	3,253,399.51
本期利润	-14,990,152.48	-4,257,497.14
加权平均基金份额本期利润	-0.0858	-0.0190
本期加权平均净值利润率	-7.66%	-1.73%
本期基金份额净值增长率	-3.53%	-3.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	17,604,970.16	15,609,432.20
期末可供分配基金份额利润	0.1168	0.0918
期末基金资产净值	168,384,167.47	185,613,200.40
期末基金份额净值	1.1168	1.0918
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	11.68%	9.18%

注：

- 1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；
- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博道久航混合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	-3.82%	0.95%	-3.26%	0.45%	-0.56%	0.50%

过去三个月	-1.18%	1.06%	-2.22%	0.66%	1.04%	0.40%
过去六个月	-3.53%	1.44%	-0.55%	0.82%	-2.98%	0.62%
过去一年	-5.36%	1.13%	-8.55%	0.74%	3.19%	0.39%
过去三年	-24.33%	1.08%	-24.40%	0.83%	0.07%	0.25%
自基金合同生效起至今	11.68%	1.14%	-3.87%	0.93%	15.55%	0.21%

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。

博道久航混合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	-3.87%	0.94%	-3.26%	0.45%	-0.61%	0.49%
过去三个月	-1.30%	1.06%	-2.22%	0.66%	0.92%	0.40%
过去六个月	-3.77%	1.44%	-0.55%	0.82%	-3.22%	0.62%
过去一年	-5.82%	1.13%	-8.55%	0.74%	2.73%	0.39%
过去三年	-25.45%	1.08%	-24.40%	0.83%	-1.05%	0.25%
自基金合同生效起至今	9.18%	1.14%	-3.87%	0.93%	13.05%	0.21%

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

博道久航混合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12月24日-2024年06月30日)



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

博道久航混合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12月24日-2024年06月30日)



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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博道基金管理有限公司由中国证监会证监许可[2017]822号文核准设立，于2017年6月12日成立，注册地在中国上海，注册资本金为1亿元人民币。截至报告期末，公司旗下发行并管理了29只公募基金：博道启航混合型证券投资基金、博道卓远混合型证券投资基金、博道中证500指数增强型证券投资基金、博道沪深300指数增强型证券投资基金、博道远航混合型证券投资基金、博道叁佰智航股票型证券投资基金、博道志远混合型证券投资基金、博道伍佰智航股票型证券投资基金、博道嘉泰回报混合型证券投资基金、博道久航混合型证券投资基金、博道嘉瑞混合型证券投资基金、博道安远6个月持有期混合型证券投资基金、博道嘉元混合型证券投资基金、博道嘉兴一年持有期混合型证券投资基金、博道睿见一年持有期混合型证券投资基金、博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金、博道嘉丰混合型证券投资基金、博道消费智航股票型证券投资基金、博道盛彦混合型证券投资基金、博道成长智航股票型证券投资基金、博道盛兴一年持有期混合型证券投资基金、博道研究恒选混合型证券投资基金、博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金、博道惠泰优选混合型证券投资基金、博道和祥多元稳健债券型证券投资基金、博道中证1000指数增强型证券投资基金、博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、博道红利智航股票型证券投资基金和博道明远混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨梦	博道中证500增强、博道沪深300增强、博道远航混合、博道叁佰智航、博道伍佰智航、博道久航混合、博道成长智航股票、博道中证1000指数增强、博道红利智航股票的基金经理、量化投资总监兼量	2019-12-24	-	13年	杨梦女士，中国籍，经济学硕士。2011年7月至2014年6月担任农银汇理基金管理有限公司量化研究员，2014年6月至2014年11月担任华泰资产管理有限公司量化研究员，2014年11月至2017年7月担任上海博道投资管理有限公司投资经理助理、投资经理。2017年8月加入

	化投资部总经理			<p>博道基金管理有限公司，现任量化投资总监兼量化投资部总经理。具有基金从业资格。自2018年8月10日至2024年4月27日担任博道启航混合型证券投资基金基金经理、自2019年1月3日起担任博道中证500指数增强型证券投资基金基金经理至今、自2019年4月26日起担任博道沪深300指数增强型证券投资基金基金经理至今、自2019年4月30日起担任博道远航混合型证券投资基金基金经理至今、自2019年6月5日起担任博道叁佰智航股票型证券投资基金基金经理至今、自2019年9月26日起担任博道伍佰智航股票型证券投资基金基金经理至今、自2019年12月24日起担任博道久航混合型证券投资基金基金经理至今、自2021年5月7日至2024年4月27日担任博道消费智航股票型证券投资基金基金经理、自2021年10月26日起担任博道成长智航股票型证券投资基金基金经理至今、自2023年8月25日起担任博道中证1000指数增强型证券投资基金基金经理至今、自2023年10月31日起担任博道红利智航股票型证券投资基金基金</p>
--	---------	--	--	--

					经理至今。
--	--	--	--	--	-------

注：

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，本公司管理的所有投资组合参与交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况共发生2次，经检查未发现异常；本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024年上半年，开年在小盘风险暴露、流动性负反馈作用下，市场情绪下降迅速，随后长期资金入市，市场出现V型反弹；二季度PMI边际回落，企业盈利仍然较弱。整体上半年，沪深300上涨0.89%，中证500下跌8.96%，中证1000下跌16.84%，上证指数下跌0.25%，创业板指下跌10.99%，恒生指数上涨3.94%。从行业来看，银行、煤炭、石油石化、家电表现较好，分别上涨了19.19%、12.79%、11.36%、10.77%，消费者服务、计算机、商贸零售、传媒表现较差，分别下跌23.82%、21.62%、21.47%、21.45%。

从因子层面来看，由于2024年一季度市场波动率大幅提升，各大类因子表现分化，算法量价类因子在市场规律不明晰的情况下表现较弱，基本面和估值类因子表现较好。二季度市场环境企稳以后，基本面和估值类因子表现持续强势，AI量价表现也震荡上行。风险因子中，市值因子和非线性市值因子在一季度经历了较大的回撤，而通常量化增强类产品为了追求更大的超额空间，一般都会适度承担一定市值敞口的暴露，因此在风险因子高波动环境下，该类产品的运作经历了一次大考。

博道“指数+”系列产品对标不同的BETA，为适配不同风险偏好以及不同BETA配置需求的投资者，模型设置的风控参数也有所不同。少部分追求超额弹性、风险因子暴露略高的产品受到了市场环境的影响，超额出现了一定的波动；大部分产品风险因子暴露适中，超额波动较小且修复较快。在这轮市场考验过后，博道“指数+”系列产品在维持均衡的因子配置和较低的风格暴露下正常运行，模型层面我们继续在传统多因子模型和AI全流程多因子模型两套框架下持续迭代。

报告期间，本基金维持配置于“学习优秀主动选股基金”的几种SMART BETA选股策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2024年下半年，随着中国地产供求形势和新均衡的形成，我国将从债务驱动的高杠杆增长阶段，逐渐进入到创新驱动的高质量增长时代。对应的资本市场监管和金融统计方式都在发生变化，包括新国九条开启资本市场建设的新篇章、二季度统计局的金融增加值核算方式优化调整等，三中全会也勾勒了包括财税、要素市场化等更深层次的治理框架，相关政策红利可能成为新的投资线索。

本基金将继续坚持SMART BETA量化选股思路，秉持勤勉尽责，力争为投资者获得有竞争力的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的投资研究相关人员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，

进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司估值委员会审批。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规的规定，遵守基金合同和托管协议的约定，勤勉尽责履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本次报告期内，基金托管人根据相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在损害基金份额持有人利益的行为，基金管理人在各重要方面的运作符合法律规定和基金合同约定。

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

基金托管人复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，以上内容真实、准确和完整。

§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：博道久航混合型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	10,375,229.01	25,777,441.76
结算备付金		63,284.44	62,902.36
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	344,222,812.37	384,953,992.46
其中：股票投资		325,301,733.79	363,820,709.45
基金投资		-	-
债券投资		18,921,078.58	21,133,283.01
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		12,592.25	107,801.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		354,673,918.07	410,902,138.37
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
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		51,580.39	60,618.67
应付管理人报酬		363,727.97	391,349.14
应付托管费		60,621.33	65,224.84
应付销售服务费		81,387.71	72,634.77
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	119,232.80	160,000.84
负债合计		676,550.20	749,828.26
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	320,782,965.51	357,582,585.16
未分配利润	6.4.7.8	33,214,402.36	52,569,724.95
净资产合计		353,997,367.87	410,152,310.11
负债和净资产总计		354,673,918.07	410,902,138.37

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：博道久航混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日
一、营业总收入		-15,490,351.23	9,943,624.20
1.利息收入		109,820.46	50,694.03
其中：存款利息收入	6.4.7.9	109,820.36	50,693.92
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	0.11
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,485,449.36	6,392,897.81
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,061,453.16	3,999,676.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	272,412.06	122,369.22
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	5,274,490.46	2,270,852.54
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	-19,568,717.42	3,495,436.49
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	483,096.37	4,595.87
减：二、营业总支出		3,757,298.39	2,229,242.60
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	2,629,764.06	1,684,483.04
2.托管费	6.4.10.2.2	438,293.99	280,747.15
3.销售服务费		612,322.24	172,459.34
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		2,327.22	7,250.22
其中：卖出回购金融资产支出		2,327.22	7,250.22
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	0.29

8.其他费用	6.4.7.17	74,590.88	84,302.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-19,247,649.62	7,714,381.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,247,649.62	7,714,381.60
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-19,247,649.62	7,714,381.60

6.3 净资产变动表

会计主体：博道久航混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	357,582,585.16	52,569,724.95	410,152,310.11
二、本期期初净资产	357,582,585.16	52,569,724.95	410,152,310.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-36,799,619.65	-19,355,322.59	-56,154,942.24
（一）、综合收益总额	-	-19,247,649.62	-19,247,649.62
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-36,799,619.65	-107,672.97	-36,907,292.62
其中：1.基金申购款	290,260,611.33	26,299,232.61	316,559,843.94

2.基金赎回款	-327,060,230.98	-26,406,905.58	-353,467,136.56
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	320,782,965.51	33,214,402.36	353,997,367.87
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	216,858,036.62	30,751,235.67	247,609,272.29
二、本期期初净资产	216,858,036.62	30,751,235.67	247,609,272.29
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-45,293,851.51	-1,073,593.11	-46,367,444.62
(一)、综合收益总额	-	7,714,381.60	7,714,381.60
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-45,293,851.51	-8,787,974.71	-54,081,826.22
其中：1.基金申购款	2,654,410.02	479,283.75	3,133,693.77
2.基金赎回款	-47,948,261.53	-9,267,258.46	-57,215,519.99
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少)	-	-	-

以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	171,564,185.11	29,677,642.56	201,241,827.67

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

博道久航混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]2205号《关于准予博道久航混合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《博道久航混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,928,396,615.02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0751号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道久航混合型证券投资基金基金合同》于2019年12月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,929,027,886.06份基金份额，其中认购资金利息折合631,271.04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，基金托管人为兴业证券股份有限公司。

根据《博道久航混合型证券投资基金基金合同》和《博道久航混合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《博道久航混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金股票资产占基金资产的比例为50%-95%。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800指数收益率 \times 80%+上证国债指数收益率 \times 20%。

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》、《博道久航混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年01月01日至2024年06月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2024年06月30日的财务状况以及2024年01月01日至2024年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	
	2024年06月30日	
活期存款	1,655,620.87	
等于：本金	1,654,946.35	
加：应计利息	674.52	
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	8,719,608.14	
等于：本金	8,717,548.89	
加：应计利息	2,059.25	
减：坏账准备	-	
合计	10,375,229.01	

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

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	341,293,019.36	-	325,301,733.79	-15,991,285.57

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	18,622,181.40	261,332.58	18,921,078.58	37,564.60
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	18,622,181.40	261,332.58	18,921,078.58	37,564.60
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		359,915,200.76	261,332.58	344,222,812.37	-15,953,720.97

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.42
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	14,918.54
预提费用-信息披露费	69,672.34
其他应付	34,640.50
合计	119,232.80

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 博道久航混合A

金额单位：人民币元

项目 (博道久航混合A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	191,756,184.97	191,756,184.97
本期申购	49,388,978.64	49,388,978.64
本期赎回（以“-”号填列）	-90,365,966.30	-90,365,966.30
本期末	150,779,197.31	150,779,197.31

6.4.7.7.2 博道久航混合C

金额单位：人民币元

项目 (博道久航混合C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	165,826,400.19	165,826,400.19
本期申购	240,871,632.69	240,871,632.69
本期赎回（以“-”号填列）	-236,694,264.68	-236,694,264.68
本期末	170,003,768.20	170,003,768.20

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 博道久航混合A

单位：人民币元

项目 (博道久航混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	57,565,320.88	-27,322,889.82	30,242,431.06
本期期初	57,565,320.88	-27,322,889.82	30,242,431.06
本期利润	-2,932,331.71	-12,057,820.77	-14,990,152.48
本期基金份额交易产生的变动数	-6,580,887.34	8,933,578.92	2,352,691.58
其中：基金申购款	14,012,286.14	-9,088,875.20	4,923,410.94
基金赎回款	-20,593,173.48	18,022,454.12	-2,570,719.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,052,101.83	-30,447,131.67	17,604,970.16

6.4.7.8.2 博道久航混合C

单位：人民币元

项目 (博道久航混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	45,802,100.87	-23,474,806.98	22,327,293.89
本期期初	45,802,100.87	-23,474,806.98	22,327,293.89
本期利润	3,253,399.51	-7,510,896.65	-4,257,497.14
本期基金份额交易产生的变动数	503,647.04	-2,964,011.59	-2,460,364.55
其中：基金申购款	58,597,450.21	-37,221,628.54	21,375,821.67
基金赎回款	-58,093,803.17	34,257,616.95	-23,836,186.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,559,147.42	-33,949,715.22	15,609,432.20

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日

活期存款利息收入	25,316.39
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	84,121.89
结算备付金利息收入	382.08
其他	-
合计	109,820.36

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	2,993,240,626.46
减：卖出股票成本总额	2,989,718,668.60
减：交易费用	5,583,411.02
买卖股票差价收入	-2,061,453.16

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	217,589.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	54,822.21
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	272,412.06

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
----	-------------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	18,112,716.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,848,187.60
减：应计利息总额	209,675.12
减：交易费用	31.19
买卖债券差价收入	54,822.21

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	5,274,490.46
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,274,490.46

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-19,568,717.42
——股票投资	-19,556,736.02
——债券投资	-11,981.40
——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	-19,568,717.42

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	203,071.86
转换费收入	280,024.51
合计	483,096.37

注：

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

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	14,918.54
信息披露费	59,672.34
合计	74,590.88

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。经博道基金管理有限公司(以下简称“博道基金”)股东会决议批准,史伟将持有的占比3.35%公司股权转让于上海博道相形投资合伙企业(有限合伙),将持有的占比0.4%公司股权转让于张迎军。博道基金于2024年8月8日完成了工商变更登记手续。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博道基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
兴业证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注: 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
兴业证券股份有限公司	5,962,321,813.40	100.00%	2,583,759,778.74	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
兴业证券 股份有限 公司	31,053,616.00	100.00%	12,155,797.82	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
兴业证券 股份有限 公司	37,502,000.00	100.00%	62,502,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期	期末应付佣金余额	占期末应

		佣金总量的比例		付佣金总额的比例
兴业证券股份有限公司	3,704,387.39	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
兴业证券股份有限公司	1,605,315.15	100.00%	-	-

注：基金托管人受托作为本基金的证券经纪商，为本基金证券交易提供支持服务。上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,629,764.06	1,684,483.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	642,889.06	666,756.33
应支付基金管理人的净管理费	1,986,875.00	1,017,726.71

注:1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%/1.20%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×该日适用费率/当年天数。

2、根据基金管理人发布的《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》，自2023年8月14日起，本基金管理费率由1.50%调整为1.20%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	438,293.99	280,747.15

注:1、支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.25%/0.20%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×该日适用费率/当年天数。

2、根据基金管理人发布的《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》，自2023年8月14日起，本基金托管费率由0.25%调整为0.20%。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道久航混合A	博道久航混合C	合计
博道基金 管理有限 公司	-	199,689.73	199,689.73
兴业证券	-	68,464.76	68,464.76
合计	-	268,154.49	268,154.49
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道久航混合A	博道久航混合C	合计
博道基金 管理有限 公司	-	3,673.24	3,673.24

兴业证券 股份有限 公司	-	75,927.85	75,927.85
合计	-	79,601.09	79,601.09

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0.50%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×0.50%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

博道久航混合A

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	1,999,800.18	1,999,800.18
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	1,999,800.18	1,999,800.18
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.33%	1.76%

博道久航混合C

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	1,000,200.00	1,000,200.00

报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	1,000,200.00	1,000,200.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.59%	1.73%

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10~50万份。（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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业证券股份有限公司	8,719,608.14	84,121.89	11,540,671.28	32,658.90

注：基金托管人受托作为本基金的证券经纪商。上述款项为本基金存放于基金托管人基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024年01月01日至2024年06月30日				
关联方名	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

称				数量（单位：张/股）	总金额
兴业证券股份有限公司	301392	汇成真空	网下发行	2,189	26,705.80
上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
兴业证券股份有限公司	688435	英方软件	网下发行	2,508	96,959.28
兴业证券股份有限公司	301419	阿莱德	网下发行	3,292	81,641.60
兴业证券股份有限公司	688469	中芯集成	网下发行	23,942	136,229.98
兴业证券股份有限公司	301315	威士顿	网下发行	1,697	54,796.13
兴业证券股份有限公司	601916	浙商银行	配股	148,050	299,061.00

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6个月以上	创业板打新限售	126.89	188.01	513	65,094.57	96,449.13	-
301589	诺瓦星云	2024-05-30	1-6个月(含)	创业板打新限售送股	-	188.01	410	-	77,084.10	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月以上	科创板打新限售	86.96	174.93	157	13,652.72	27,464.01	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603350	安乃达	2024-06-26	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
301536	星宸科技	2024-03-20	6个月以上	创业板打新限售	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
688709	成都华微	2024-01-31	6个月以上	科创板打新限售	15.69	18.79	798	12,520.62	14,994.42	-

301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月以上	创业板打新限售	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024-05-22	1-6个月(含)	创业板打新限售送股	-	91.24	43	-	3,923.32	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月以上	创业板打新限售	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月以上	创业板打新限售	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月以上	科创板打新限售	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月以上	科创板打新限售	22.66	15.89	626	14,185.16	9,947.14	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月以上	创业板打新限售	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月以上	创业板打新限售	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-

301591	肯特股份	2024-02-20	6个月以上	创业板打新限售	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月以上	主板打新限售	16.20	15.96	499	8,083.80	7,964.04	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月以上	创业板打新限售	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024-03-26	6个月以上	主板打新限售	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月以上	创业板打新限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月以上	科创板打新限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6个月以上	科创板打新限售	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024-03-06	6个月以上	创业板打新限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月以上	创业板打新限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-

				售						
603344	星德胜	2024-03-13	6个月以上	主板打新限售	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月以上	主板打新限售	23.35	25.13	164	3,829.40	4,121.32	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6个月以上	主板打新限售	72.46	68.06	59	4,275.14	4,015.54	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月以上	主板打新限售	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603312	西典新能	2024-01-04	6个月以上	主板打新限售	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自科技	2024-01-23	6个月以上	主板打新限售	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月以上	主板打新限售	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6个月以上	主板打新限售	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月以上	主板打新限售	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024-06-03	1-6个月(含)	主板打新限售送股	-	15.25	40	-	610.00	-
6032	键邦	2024	6个月以	主板	18.65	18.65	129	2,40	2,40	-

85	股份	-06-28	上	打新限售				5.85	5.85	
603350	安乃达	2024-06-26	6个月以上	主板打新限售	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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兴业证券开立于兴业银行股份有限公司的托管账户，其他存款存放于兴业证券，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易

所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于2024年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2023年12月31日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于2024年6月30日，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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出

回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2024年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.13%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2024年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为354,171,090.85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	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

2024年 06月30 日							
资产							
货币资金	10,375,229.01	-	-	-	-	-	10,375,229.01
结算备付金	63,284.44	-	-	-	-	-	63,284.44
交易性金融资产	8,155,389.00	-	10,765,689.58	-	-	325,301,733.79	344,222,812.37
应收申购款	-	-	-	-	-	12,592.25	12,592.25
资产总计	18,593,902.45	-	10,765,689.58	-	-	325,314,326.04	354,673,918.07
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	51,580.39	51,580.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	363,727.97	363,727.97
应付托管费	-	-	-	-	-	60,621.33	60,621.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-	81,387.71	81,387.71
其他负债	-	-	-	-	-	119,232.80	119,232.80
负债总计	-	-	-	-	-	676,550.20	676,550.20
利率敏感度缺口	18,593,902.45	-	10,765,689.58	-	-	324,637,775.84	353,997,367.87
上年度末 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	25,777,441.76	-	-	-	-	-	25,777,441.76
结算备	62,902.36	-	-	-	-	-	62,902.36

付金							
交易性金融资产	-	-	21,133,283.01	-	-	363,820,709.45	384,953,992.46
应收申购款	-	-	-	-	-	107,801.79	107,801.79
资产总计	25,840,344.12	-	21,133,283.01	-	-	363,928,511.24	410,902,138.37
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	60,618.67	60,618.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	391,349.14	391,349.14
应付托管费	-	-	-	-	-	65,224.84	65,224.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-	72,634.77	72,634.77
其他负债	-	-	-	-	-	160,000.84	160,000.84
负债总计	-	-	-	-	-	749,828.26	749,828.26
利率敏感度缺口	25,840,344.12	-	21,133,283.01	-	-	363,178,682.98	410,152,310.11

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2024年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为5.34% (2023年12月31日：5.15%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响 (2023年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金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占基金资产的50%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值5%，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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	325,301,733.79	91.89	363,820,709.45	88.70
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	325,301,733.79	91.89	363,820,709.45	88.70

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证800指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	1.中证800指数收益率上升5%	17,179,711.62	15,464,320.24
	2.中证800指数收益率下降5%	-17,179,711.62	-15,464,320.24

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	324,853,243.19	363,113,789.01
第二层次	18,966,689.69	21,133,283.01
第三层次	402,879.49	706,920.44
合计	344,222,812.37	384,953,992.46

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	325,301,733.79	91.72
	其中：股票	325,301,733.79	91.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,921,078.58	5.33
	其中：债券	18,921,078.58	5.33
	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	10,438,513.45	2.94
8	其他各项资产	12,592.25	0.00
9	合计	354,673,918.07	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	189,848.00	0.05
B	采矿业	18,242,527.00	5.15
C	制造业	250,018,012.85	70.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,903,022.00	1.95
E	建筑业	4,366,886.00	1.23
F	批发和零售业	4,333,316.00	1.22
G	交通运输、仓储和邮政业	1,001,339.00	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,296,519.20	5.45
J	金融业	14,178,959.50	4.01
K	房地产业	977,609.00	0.28
L	租赁和商务服务业	360,204.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	150,720.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	2,850,761.04	0.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,047,200.00	0.30
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	113,481.00	0.03
S	综合	1,271,329.20	0.36

	合计	325,301,733.79	91.89
--	----	----------------	-------

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601633	长城汽车	274,100	6,934,730.00	1.96
2	600690	海尔智家	236,600	6,714,708.00	1.90
3	601717	郑煤机	396,900	5,874,120.00	1.66
4	600282	南钢股份	1,036,800	5,163,264.00	1.46
5	601058	赛轮轮胎	313,000	4,382,000.00	1.24
6	600183	生益科技	189,500	3,990,870.00	1.13
7	000921	海信家电	120,200	3,875,248.00	1.09
8	600519	贵州茅台	2,506	3,677,279.34	1.04
9	000703	恒逸石化	473,200	3,354,988.00	0.95
10	000333	美的集团	51,846	3,344,067.00	0.94
11	002035	华帝股份	501,900	3,126,837.00	0.88
12	603408	建霖家居	219,800	2,899,162.00	0.82
13	603993	洛阳钼业	331,500	2,817,750.00	0.80
14	002601	龙佰集团	148,300	2,753,931.00	0.78
15	601500	通用股份	511,100	2,729,274.00	0.77
16	002128	电投能源	128,700	2,715,570.00	0.77
17	002008	大族激光	123,900	2,577,120.00	0.73
18	002139	拓邦股份	239,300	2,541,366.00	0.72
19	600219	南山铝业	645,100	2,457,831.00	0.69
20	000975	银泰黄金	149,800	2,440,242.00	0.69
21	300872	天阳科技	180,900	2,396,925.00	0.68

22	300002	神州泰岳	293,700	2,384,844.00	0.67
23	002315	焦点科技	85,500	2,305,080.00	0.65
24	601318	中国平安	55,500	2,295,480.00	0.65
25	688578	艾力斯	35,975	2,293,046.50	0.65
26	600938	中国海油	67,800	2,237,400.00	0.63
27	603579	荣泰健康	143,600	2,220,056.00	0.63
28	600809	山西汾酒	10,100	2,129,888.00	0.60
29	603558	健盛集团	204,200	2,031,790.00	0.57
30	000651	格力电器	49,700	1,949,234.00	0.55
31	000544	中原环保	245,400	1,931,298.00	0.55
32	000550	江铃汽车	88,900	1,930,019.00	0.55
33	603160	汇顶科技	27,900	1,918,125.00	0.54
34	000977	浪潮信息	52,300	1,902,151.00	0.54
35	601636	旗滨集团	291,300	1,878,885.00	0.53
36	002282	博深股份	291,900	1,865,241.00	0.53
37	300679	电连技术	45,900	1,846,557.00	0.52
38	688076	诺泰生物	23,400	1,831,752.00	0.52
39	002984	森麒麟	74,600	1,797,114.00	0.51
40	605333	沪光股份	64,100	1,785,185.00	0.50
41	603658	安图生物	38,300	1,764,481.00	0.50
42	002380	科远智慧	96,100	1,758,630.00	0.50
43	688408	中信博	19,050	1,754,124.00	0.50
44	600941	中国移动	16,118	1,732,685.00	0.49
45	301301	川宁生物	133,800	1,709,964.00	0.48
46	002078	太阳纸业	122,100	1,703,295.00	0.48
47	600028	中国石化	268,300	1,695,656.00	0.48
48	002201	正威新材	352,000	1,664,960.00	0.47
49	000830	鲁西化工	143,000	1,657,370.00	0.47
50	002026	山东威达	196,200	1,628,460.00	0.46
51	600926	杭州银行	121,300	1,582,965.00	0.45
52	601616	广电电气	514,600	1,497,486.00	0.42

53	600299	安迪苏	153,800	1,491,860.00	0.42
54	601668	中国建筑	279,600	1,484,676.00	0.42
55	688036	传音控股	19,320	1,478,752.80	0.42
56	300559	佳发教育	151,600	1,450,812.00	0.41
57	600285	羚锐制药	59,200	1,433,232.00	0.40
58	301187	欧圣电气	59,100	1,433,175.00	0.40
59	600582	天地科技	207,500	1,429,675.00	0.40
60	605369	拱东医疗	35,500	1,416,450.00	0.40
61	002897	意华股份	37,459	1,410,705.94	0.40
62	300842	帝科股份	36,200	1,404,560.00	0.40
63	603610	麒盛科技	141,596	1,398,968.48	0.40
64	601001	晋控煤业	83,500	1,379,420.00	0.39
65	000521	长虹美菱	178,200	1,350,756.00	0.38
66	600114	东睦股份	93,400	1,344,026.00	0.38
67	000788	北大医药	267,900	1,336,821.00	0.38
68	600873	梅花生物	130,100	1,303,602.00	0.37
69	000157	中联重科	168,300	1,292,544.00	0.37
70	000883	湖北能源	214,700	1,290,347.00	0.36
71	600566	济川药业	40,400	1,281,084.00	0.36
72	600887	伊利股份	48,500	1,253,240.00	0.35
73	603556	海兴电力	26,600	1,245,678.00	0.35
74	300394	天孚通信	14,020	1,239,648.40	0.35
75	600066	宇通客车	47,800	1,233,240.00	0.35
76	300005	探路者	242,600	1,215,426.00	0.34
77	301345	涛涛车业	21,900	1,206,690.00	0.34
78	601857	中国石油	115,500	1,191,960.00	0.34
79	002533	金杯电工	118,000	1,174,100.00	0.33
80	688533	上声电子	44,600	1,153,802.00	0.33
81	605018	长华集团	124,700	1,129,782.00	0.32
82	688480	赛恩斯	40,400	1,125,544.00	0.32
83	300102	乾照光电	172,600	1,108,092.00	0.31

84	688766	普冉股份	11,320	1,099,964.40	0.31
85	300950	德固特	71,900	1,095,756.00	0.31
86	000532	华金资本	90,500	1,091,430.00	0.31
87	605555	德昌股份	58,300	1,084,963.00	0.31
88	600900	长江电力	37,400	1,081,608.00	0.31
89	002106	莱宝高科	98,800	1,076,920.00	0.30
90	688678	福立旺	98,360	1,065,238.80	0.30
91	601186	中国铁建	124,100	1,063,537.00	0.30
92	000526	学大教育	17,000	1,047,200.00	0.30
93	300743	天地数码	76,500	1,035,810.00	0.29
94	300577	开润股份	49,500	1,031,085.00	0.29
95	603568	伟明环保	50,100	1,031,058.00	0.29
96	000513	丽珠集团	27,700	1,030,717.00	0.29
97	688616	西力科技	90,000	1,020,600.00	0.29
98	688138	清溢光电	47,237	1,015,595.50	0.29
99	688767	博拓生物	40,400	1,012,828.00	0.29
100	300529	健帆生物	37,000	1,006,770.00	0.28
101	601700	风范股份	228,900	1,004,871.00	0.28
102	301309	万得凯	39,000	996,840.00	0.28
103	601916	浙商银行	351,300	969,588.00	0.27
104	300307	慈星股份	149,600	890,120.00	0.25
105	301299	卓创资讯	20,800	873,600.00	0.25
106	002517	恺英网络	91,100	870,005.00	0.25
107	300233	金城医药	57,800	862,376.00	0.24
108	600300	维维股份	350,900	842,160.00	0.24
109	601169	北京银行	141,300	825,192.00	0.23
110	600642	申能股份	92,400	815,892.00	0.23
111	002557	洽洽食品	28,900	814,691.00	0.23
112	603158	腾龙股份	114,100	803,264.00	0.23
113	300857	协创数据	14,000	798,000.00	0.23
114	000409	云鼎科技	96,400	777,948.00	0.22

115	600096	云天化	39,400	765,148.00	0.22
116	603577	汇金通	109,800	762,012.00	0.22
117	002469	三维化学	130,700	744,990.00	0.21
118	603992	松霖科技	40,500	744,795.00	0.21
119	600547	山东黄金	27,100	741,998.00	0.21
120	000725	京东方 A	180,700	739,063.00	0.21
121	003019	宸展光电	28,966	733,708.78	0.21
122	301498	乖宝宠物	13,500	726,300.00	0.21
123	301157	华塑科技	22,100	720,460.00	0.20
124	601702	华峰铝业	39,400	719,444.00	0.20
125	002422	科伦药业	23,700	718,821.00	0.20
126	688517	金冠电气	51,200	715,776.00	0.20
127	600999	招商证券	51,200	712,192.00	0.20
128	600916	中国黄金	73,900	710,918.00	0.20
129	003023	彩虹集团	44,400	708,180.00	0.20
130	688169	石头科技	1,800	706,680.00	0.20
131	603726	朗迪集团	52,100	698,140.00	0.20
132	600776	东方通信	71,000	697,930.00	0.20
133	688226	威腾电气	39,800	695,704.00	0.20
134	003025	思进智能	56,500	695,515.00	0.20
135	301429	森泰股份	45,300	693,090.00	0.20
136	002830	名雕股份	70,300	691,752.00	0.20
137	300623	捷捷微电	39,900	690,270.00	0.19
138	603228	景旺电子	21,700	690,060.00	0.19
139	000551	创元科技	78,500	685,305.00	0.19
140	300915	海融科技	26,200	684,868.00	0.19
141	600989	宝丰能源	39,300	681,069.00	0.19
142	001207	联科科技	46,400	673,728.00	0.19
143	603351	威尔药业	33,100	670,606.00	0.19
144	002948	青岛银行	198,000	667,260.00	0.19
145	688506	百利天恒	3,650	662,110.00	0.19

146	301219	腾远钴业	17,200	658,072.00	0.19
147	603239	浙江仙通	47,800	655,338.00	0.19
148	002688	金河生物	179,900	653,037.00	0.18
149	300207	欣旺达	43,000	652,310.00	0.18
150	600872	中炬高新	28,400	644,396.00	0.18
151	002267	陕天然气	84,500	638,820.00	0.18
152	601567	三星医疗	18,200	637,000.00	0.18
153	605339	南侨食品	44,600	634,212.00	0.18
154	000568	泸州老窖	4,400	631,356.00	0.18
155	605499	东鹏饮料	2,900	625,675.00	0.18
156	000999	华润三九	14,650	623,797.00	0.18
157	603025	大豪科技	45,100	623,282.00	0.18
158	601899	紫金矿业	35,100	616,707.00	0.17
159	002589	瑞康医药	278,900	613,580.00	0.17
160	002340	格林美	96,200	612,794.00	0.17
161	002558	巨人网络	64,600	609,824.00	0.17
162	603299	苏盐井神	63,700	605,150.00	0.17
163	601398	工商银行	106,100	604,770.00	0.17
164	002404	嘉欣丝绸	113,100	598,299.00	0.17
165	603676	卫信康	74,600	597,546.00	0.17
166	300453	三鑫医疗	93,200	595,548.00	0.17
167	600036	招商银行	17,400	594,906.00	0.17
168	002988	豪美新材	38,600	592,510.00	0.17
169	301280	珠城科技	15,200	589,760.00	0.17
170	000338	潍柴动力	36,000	584,640.00	0.17
171	002534	西子洁能	58,400	584,584.00	0.17
172	002879	长缆科技	44,400	582,972.00	0.16
173	002463	沪电股份	15,900	580,350.00	0.16
174	688253	英诺特	15,182	578,586.02	0.16
175	002594	比亚迪	2,300	575,575.00	0.16
176	603112	华翔股份	52,900	555,979.00	0.16

177	605488	福莱新材	42,100	547,300.00	0.15
178	300349	金卡智能	45,800	545,936.00	0.15
179	603019	中科曙光	13,100	543,650.00	0.15
180	002635	安洁科技	35,200	543,488.00	0.15
181	603777	来伊份	57,240	536,338.80	0.15
182	002415	海康威视	17,300	534,743.00	0.15
183	000807	云铝股份	38,700	522,837.00	0.15
184	300566	激智科技	36,900	516,231.00	0.15
185	603967	中创物流	55,500	516,150.00	0.15
186	002763	汇洁股份	77,300	512,499.00	0.14
187	002303	美盈森	212,300	511,643.00	0.14
188	002273	水晶光电	30,100	511,098.00	0.14
189	603897	长城科技	29,000	508,950.00	0.14
190	601128	常熟银行	66,550	503,783.50	0.14
191	300783	三只松鼠	22,400	489,888.00	0.14
192	300750	宁德时代	2,700	486,081.00	0.14
193	001338	永顺泰	49,600	486,080.00	0.14
194	301062	上海艾录	47,200	481,912.00	0.14
195	002296	辉煌科技	46,700	481,477.00	0.14
196	601601	中国太保	17,200	479,192.00	0.14
197	603926	铁流股份	57,500	477,250.00	0.13
198	300428	立中集团	24,600	457,314.00	0.13
199	603681	永冠新材	35,800	456,450.00	0.13
200	603238	诺邦股份	45,800	456,168.00	0.13
201	300218	安利股份	30,100	453,908.00	0.13
202	300979	华利集团	7,400	450,290.00	0.13
203	301283	聚胶股份	15,800	448,246.00	0.13
204	600971	恒源煤电	37,500	447,750.00	0.13
205	688099	晶晨股份	7,534	446,916.88	0.13
206	603369	今世缘	9,600	443,520.00	0.13
207	600062	华润双鹤	22,500	440,550.00	0.12

208	000030	富奥股份	89,100	437,481.00	0.12
209	300441	鲍斯股份	73,600	436,448.00	0.12
210	600820	隧道股份	65,600	428,368.00	0.12
211	300424	航新科技	35,000	428,050.00	0.12
212	603048	浙江黎明	29,200	423,984.00	0.12
213	300181	佐力药业	27,900	421,848.00	0.12
214	002164	宁波东力	109,600	420,864.00	0.12
215	603385	惠达卫浴	76,600	420,534.00	0.12
216	603277	银都股份	13,900	417,556.00	0.12
217	601988	中国银行	90,200	416,724.00	0.12
218	002098	浔兴股份	74,100	416,442.00	0.12
219	601658	邮储银行	81,900	415,233.00	0.12
220	603706	东方环宇	28,300	414,595.00	0.12
221	300707	威唐工业	33,200	411,016.00	0.12
222	603421	鼎信通讯	91,900	409,874.00	0.12
223	603201	常润股份	16,900	408,980.00	0.12
224	601997	贵阳银行	77,600	408,952.00	0.12
225	300194	福安药业	109,000	407,660.00	0.12
226	605500	森林包装	66,100	406,515.00	0.11
227	603337	杰克股份	15,100	397,432.00	0.11
228	002570	贝因美	168,500	394,290.00	0.11
229	300045	华力创通	22,100	390,065.00	0.11
230	003000	劲仔食品	32,300	389,215.00	0.11
231	603348	文灿股份	14,000	387,660.00	0.11
232	000818	航锦科技	17,500	386,400.00	0.11
233	600007	中国国贸	17,400	382,104.00	0.11
234	002333	罗普斯金	71,000	381,270.00	0.11
235	002835	同为股份	22,500	380,025.00	0.11
236	301316	慧博云通	25,800	378,744.00	0.11
237	603192	汇得科技	28,000	376,040.00	0.11
238	600000	浦发银行	44,700	367,881.00	0.10

239	300694	蠡湖股份	43,200	367,632.00	0.10
240	603165	荣晟环保	34,500	366,390.00	0.10
241	603298	杭叉集团	18,640	366,089.60	0.10
242	600699	均胜电子	24,600	364,572.00	0.10
243	002891	中宠股份	17,400	363,138.00	0.10
244	601963	重庆银行	46,600	361,150.00	0.10
245	000555	神州信息	38,700	360,684.00	0.10
246	603015	弘讯科技	47,700	360,612.00	0.10
247	002449	国星光电	50,400	358,848.00	0.10
248	603353	和顺石油	27,600	357,696.00	0.10
249	002697	红旗连锁	77,100	356,973.00	0.10
250	601665	齐鲁银行	72,500	355,975.00	0.10
251	300758	七彩化学	32,800	352,600.00	0.10
252	002787	华源控股	51,900	350,844.00	0.10
253	001309	德明利	4,000	345,600.00	0.10
254	600711	盛屯矿业	93,700	343,879.00	0.10
255	600332	白云山	11,600	340,228.00	0.10
256	301077	星华新材	19,000	339,340.00	0.10
257	002083	孚日股份	80,200	339,246.00	0.10
258	601512	中新集团	44,300	337,566.00	0.10
259	002155	湖南黄金	18,500	334,850.00	0.09
260	600480	凌云股份	33,800	332,254.00	0.09
261	002996	顺博合金	56,700	331,695.00	0.09
262	603617	君禾股份	56,200	331,580.00	0.09
263	600177	雅戈尔	46,500	331,080.00	0.09
264	688510	航亚科技	17,980	331,011.80	0.09
265	600346	恒力石化	23,700	330,615.00	0.09
266	002286	保龄宝	60,000	330,600.00	0.09
267	002249	大洋电机	69,500	328,735.00	0.09
268	601288	农业银行	74,800	326,128.00	0.09
269	001206	依依股份	24,900	324,198.00	0.09

270	603195	公牛集团	4,200	323,904.00	0.09
271	002969	嘉美包装	113,100	322,335.00	0.09
272	002536	飞龙股份	33,800	321,776.00	0.09
273	300908	仲景食品	11,500	319,470.00	0.09
274	603727	博迈科	24,000	315,840.00	0.09
275	601728	中国电信	50,800	312,420.00	0.09
276	002686	亿利达	74,500	312,155.00	0.09
277	002942	新农股份	26,300	310,077.00	0.09
278	000858	五粮液	2,400	307,296.00	0.09
279	002916	深南电路	2,900	306,733.00	0.09
280	601077	渝农商行	60,800	305,216.00	0.09
281	000589	贵州轮胎	60,200	305,214.00	0.09
282	002053	云南能投	25,100	303,459.00	0.09
283	002241	歌尔股份	15,500	302,405.00	0.09
284	300482	万孚生物	12,300	300,120.00	0.08
285	600694	大商股份	17,820	299,554.20	0.08
286	603221	爱丽家居	33,600	298,032.00	0.08
287	000581	威孚高科	18,300	297,924.00	0.08
288	603738	泰晶科技	21,700	295,988.00	0.08
289	603788	宁波高发	24,100	295,948.00	0.08
289	603511	爱慕股份	24,100	295,948.00	0.08
291	601800	中国交建	33,100	295,914.00	0.08
292	301061	匠心家居	6,190	290,682.40	0.08
293	601958	金钼股份	27,900	290,439.00	0.08
294	603379	三美股份	7,300	285,722.00	0.08
295	603321	梅轮电梯	41,800	285,494.00	0.08
296	300308	中际旭创	2,060	284,032.80	0.08
297	603198	迎驾贡酒	4,900	281,750.00	0.08
298	605166	聚合顺	26,400	276,936.00	0.08
299	603786	科博达	4,300	275,845.00	0.08
300	601088	中国神华	6,200	275,094.00	0.08

301	601939	建设银行	36,500	270,100.00	0.08
302	603367	辰欣药业	19,300	269,042.00	0.08
303	002274	华昌化工	36,200	268,604.00	0.08
304	600727	鲁北化工	42,500	267,750.00	0.08
305	002906	华阳集团	10,000	267,600.00	0.08
306	600351	亚宝药业	46,900	263,109.00	0.07
307	600210	紫江企业	49,000	260,680.00	0.07
307	002602	世纪华通	76,000	260,680.00	0.07
309	002876	三利谱	10,700	258,084.00	0.07
310	600503	华丽家族	144,100	257,939.00	0.07
311	000758	中色股份	49,900	253,492.00	0.07
312	601328	交通银行	33,900	253,233.00	0.07
313	688087	英科再生	9,600	248,448.00	0.07
314	601198	东兴证券	31,100	247,556.00	0.07
315	300916	朗特智能	9,800	246,764.00	0.07
316	002878	元隆雅图	19,600	246,372.00	0.07
317	001223	欧克科技	7,000	246,330.00	0.07
318	300791	仙乐健康	9,750	245,700.00	0.07
319	603686	福龙马	32,100	244,602.00	0.07
320	002660	茂硕电源	32,800	243,376.00	0.07
321	002236	大华股份	15,700	242,722.00	0.07
322	002140	东华科技	31,300	242,575.00	0.07
323	600406	国电南瑞	9,700	242,112.00	0.07
324	002970	锐明技术	6,700	241,401.00	0.07
325	300856	科思股份	7,500	240,075.00	0.07
326	002752	昇兴股份	47,175	238,705.50	0.07
327	002961	瑞达期货	21,700	237,615.00	0.07
328	301359	东南电子	9,604	234,337.60	0.07
329	001367	海森药业	9,916	231,439.44	0.07
330	603733	仙鹤股份	13,100	230,298.00	0.07
331	601628	中国人寿	7,400	229,770.00	0.06

332	001296	长江材料	16,120	229,710.00	0.06
333	601866	中远海发	88,700	228,846.00	0.06
334	603518	锦泓集团	26,000	228,800.00	0.06
335	688571	杭华股份	43,000	227,470.00	0.06
336	002662	京威股份	73,500	223,440.00	0.06
337	300401	花园生物	15,500	222,270.00	0.06
338	603611	诺力股份	13,000	221,520.00	0.06
339	603823	百合花	22,900	221,443.00	0.06
340	600308	华泰股份	70,500	221,370.00	0.06
341	002020	京新药业	21,000	219,870.00	0.06
342	002824	和胜股份	17,200	219,472.00	0.06
343	605599	莱百股份	17,200	218,956.00	0.06
344	002358	森源电气	64,000	218,880.00	0.06
345	300145	中金环境	86,900	217,250.00	0.06
346	003036	泰坦股份	27,100	216,529.00	0.06
347	300925	法本信息	21,400	215,926.00	0.06
348	002613	北玻股份	62,000	215,760.00	0.06
349	605111	新洁能	7,040	215,353.60	0.06
350	605377	华旺科技	16,180	214,385.00	0.06
351	002448	中原内配	37,200	213,528.00	0.06
352	300439	美康生物	23,200	212,512.00	0.06
353	301007	德迈仕	18,000	210,240.00	0.06
354	000419	通程控股	50,900	208,181.00	0.06
355	600025	华能水电	19,200	206,976.00	0.06
356	603903	中持股份	29,500	206,795.00	0.06
357	603368	柳药集团	11,800	206,500.00	0.06
358	002228	合兴包装	87,500	204,750.00	0.06
359	688307	中润光学	9,800	202,762.00	0.06
360	603380	易德龙	10,000	200,800.00	0.06
361	300502	新易盛	1,900	200,545.00	0.06
362	300638	广和通	11,700	200,070.00	0.06

363	300652	雷迪克	10,000	198,300.00	0.06
364	688129	东来技术	15,800	197,342.00	0.06
365	002722	物产金轮	17,300	195,490.00	0.06
366	601229	上海银行	26,600	193,116.00	0.05
367	301526	国际复材	57,516	191,528.28	0.05
368	600674	川投能源	10,200	191,250.00	0.05
369	688800	瑞可达	6,800	190,944.00	0.05
370	600598	北大荒	15,200	189,848.00	0.05
371	001222	源飞宠物	15,100	184,975.00	0.05
372	603115	海星股份	17,700	184,080.00	0.05
373	000833	粤桂股份	38,440	179,899.20	0.05
374	603041	美思德	17,400	174,000.00	0.05
375	301589	诺瓦星云	923	173,533.23	0.05
376	002392	北京利尔	54,900	172,935.00	0.05
377	000153	丰原药业	31,900	171,622.00	0.05
378	600420	国药现代	16,023	171,125.64	0.05
379	688018	乐鑫科技	1,728	170,519.04	0.05
380	002555	三七互娱	13,000	169,650.00	0.05
381	002454	松芝股份	30,300	169,377.00	0.05
382	688210	统联精密	7,600	168,340.00	0.05
383	601818	光大银行	53,100	168,327.00	0.05
384	603073	彩蝶实业	11,500	166,290.00	0.05
385	603088	宁波精达	21,600	162,648.00	0.05
386	002540	亚太科技	30,700	162,403.00	0.05
387	600309	万华化学	2,000	161,720.00	0.05
388	601886	江河集团	32,800	160,064.00	0.05
389	002137	实益达	33,600	159,936.00	0.05
390	000700	模塑科技	30,400	159,600.00	0.05
391	688468	科美诊断	25,200	159,516.00	0.05
392	002393	力生制药	9,940	157,151.40	0.04
393	603258	电魂网络	9,600	155,040.00	0.04

394	688590	新致软件	12,000	154,800.00	0.04
395	002318	久立特材	6,600	153,978.00	0.04
396	601600	中国铝业	20,000	152,600.00	0.04
397	300492	华图山鼎	1,600	150,720.00	0.04
398	000570	苏常柴A	33,300	148,851.00	0.04
399	002215	诺普信	19,900	148,255.00	0.04
400	600030	中信证券	8,100	147,663.00	0.04
401	600152	维科技术	30,500	146,400.00	0.04
402	002615	哈尔斯	23,600	146,320.00	0.04
403	603309	维力医疗	13,200	145,332.00	0.04
404	601808	中海油服	8,400	144,480.00	0.04
405	300674	宇信科技	12,900	142,932.00	0.04
406	002073	软控股份	19,200	141,888.00	0.04
407	603948	建业股份	8,700	141,636.00	0.04
408	002436	兴森科技	13,500	139,320.00	0.04
409	002774	快意电梯	21,800	138,430.00	0.04
410	000828	东莞控股	15,100	136,051.00	0.04
411	300907	康平科技	7,100	134,829.00	0.04
412	002616	长青集团	31,000	133,920.00	0.04
413	603630	拉芳家化	12,700	133,477.00	0.04
414	688080	映翰通	4,400	133,452.00	0.04
415	002966	苏州银行	17,600	132,000.00	0.04
416	001209	洪兴股份	9,500	131,100.00	0.04
417	603987	康德莱	21,300	130,143.00	0.04
418	605288	凯迪股份	4,200	130,032.00	0.04
419	002304	洋河股份	1,600	129,184.00	0.04
420	002029	七匹狼	25,100	126,504.00	0.04
421	601956	东贝集团	27,400	125,492.00	0.04
422	603798	康普顿	14,900	125,458.00	0.04
423	688028	沃尔德	7,628	125,328.04	0.04
424	603150	万朗磁塑	5,000	125,200.00	0.04

425	300105	龙源技术	19,300	124,678.00	0.04
426	600160	巨化股份	5,100	123,063.00	0.03
427	002046	国机精工	12,000	122,040.00	0.03
428	603161	科华控股	8,100	121,257.00	0.03
429	002598	山东章鼓	16,300	120,946.00	0.03
430	605088	冠盛股份	5,800	120,872.00	0.03
431	603338	浙江鼎力	2,000	120,840.00	0.03
432	000417	合肥百货	29,100	120,765.00	0.03
433	603871	嘉友国际	6,800	120,292.00	0.03
434	000404	长虹华意	22,300	118,859.00	0.03
435	605198	安德利	4,500	118,800.00	0.03
436	300303	聚飞光电	24,300	118,098.00	0.03
437	300174	元力股份	8,600	117,390.00	0.03
438	000951	中国重汽	8,100	115,992.00	0.03
439	605189	富春染织	10,800	115,128.00	0.03
440	002833	弘亚数控	6,300	114,912.00	0.03
441	002442	龙星化工	26,700	114,810.00	0.03
442	603393	新天然气	3,300	114,642.00	0.03
443	002066	瑞泰科技	14,400	114,480.00	0.03
444	002519	银河电子	23,200	113,912.00	0.03
445	001228	永泰运	5,400	113,832.00	0.03
446	301308	江波龙	1,200	113,688.00	0.03
447	601811	新华文轩	8,100	113,481.00	0.03
448	601096	宏盛华源	27,721	113,378.89	0.03
449	002655	共达电声	10,400	112,320.00	0.03
450	002972	科安达	12,200	111,752.00	0.03
451	600664	哈药股份	42,300	111,672.00	0.03
452	600027	华电国际	16,000	111,040.00	0.03
453	002112	三变科技	12,500	111,000.00	0.03
454	603320	迪贝电气	7,800	110,292.00	0.03
455	000045	深纺织 A	13,700	109,874.00	0.03

456	001256	炜冈科技	8,000	109,760.00	0.03
457	300562	乐心医疗	12,300	109,593.00	0.03
458	600987	航民股份	15,500	109,430.00	0.03
459	002441	众业达	14,400	109,152.00	0.03
460	600362	江西铜业	4,600	108,928.00	0.03
461	001234	泰慕士	6,400	108,736.00	0.03
462	002054	德美化工	22,000	108,020.00	0.03
463	002297	博云新材	18,000	108,000.00	0.03
464	300547	川环科技	6,600	107,910.00	0.03
465	600919	江苏银行	14,400	106,992.00	0.03
466	601991	大唐发电	35,400	106,554.00	0.03
467	605183	确成股份	6,800	105,128.00	0.03
468	600865	百大集团	16,200	104,814.00	0.03
469	603081	大丰实业	11,200	104,384.00	0.03
470	002264	新华都	20,300	103,733.00	0.03
471	301122	采纳股份	5,500	103,565.00	0.03
472	603055	台华新材	10,200	103,326.00	0.03
473	002860	星帅尔	12,600	103,194.00	0.03
474	000826	启迪环境	73,100	100,878.00	0.03
475	688435	英方软件	4,000	99,840.00	0.03
476	301566	达利凯普	5,755	97,662.35	0.03
477	688111	金山办公	400	91,000.00	0.03
478	301578	辰奕智能	1,527	60,423.39	0.02
479	603004	鼎龙科技	1,948	33,018.60	0.01
480	002451	摩恩电气	5,800	31,146.00	0.01
481	688692	达梦数据	157	27,464.01	0.01
482	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
483	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
484	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
485	688709	成都华微	798	14,994.42	0.00
486	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00

487	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
488	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
489	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
490	688584	上海合晶	626	9,947.14	0.00
491	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
492	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
493	601033	永兴股份	499	7,964.04	0.00
494	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
495	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
496	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
497	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
498	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
499	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
500	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
501	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
502	603381	永臻股份	164	4,121.32	0.00
503	603325	博隆技术	59	4,015.54	0.00
504	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
505	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
506	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
507	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
508	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
509	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601058	赛轮轮胎	21,514,358.00	5.25

2	002558	巨人网络	18,181,944.00	4.43
3	002236	大华股份	17,808,510.38	4.34
4	600019	宝钢股份	16,667,640.00	4.06
5	002271	东方雨虹	16,297,326.00	3.97
6	601633	长城汽车	15,986,477.00	3.90
7	600312	平高电气	15,163,457.00	3.70
8	002555	三七互娱	14,411,861.00	3.51
9	605589	圣泉集团	14,148,880.00	3.45
10	600737	中粮糖业	13,823,375.00	3.37
11	000333	美的集团	12,904,999.04	3.15
12	002139	拓邦股份	12,766,984.00	3.11
13	002415	海康威视	12,665,691.00	3.09
14	000651	格力电器	12,428,202.00	3.03
15	601800	中国交建	12,063,514.00	2.94
16	600519	贵州茅台	11,942,467.00	2.91
17	603283	赛腾股份	11,524,972.20	2.81
18	002969	嘉美包装	11,119,572.00	2.71
19	600282	南钢股份	11,092,870.00	2.70
20	600690	海尔智家	11,007,903.00	2.68
21	688278	特宝生物	10,991,207.58	2.68
22	601636	旗滨集团	10,828,335.00	2.64
23	600025	华能水电	10,805,730.00	2.63
24	600867	通化东宝	10,766,059.08	2.62
25	601717	郑煤机	10,494,703.00	2.56
26	601108	财通证券	10,303,907.60	2.51
27	003000	劲仔食品	10,207,867.44	2.49
28	000921	海信家电	9,775,880.00	2.38
29	000568	泸州老窖	9,746,717.00	2.38
30	300872	天阳科技	9,576,300.20	2.33
31	300682	朗新集团	9,458,816.00	2.31
32	300001	特锐德	9,333,158.00	2.28

33	601857	中国石油	9,314,224.00	2.27
34	300002	神州泰岳	9,285,711.00	2.26
35	000338	潍柴动力	8,905,483.00	2.17
36	002273	水晶光电	8,810,188.00	2.15
37	603903	中持股份	8,670,744.04	2.11
38	300922	天秦装备	8,595,842.00	2.10
39	600938	中国海油	8,589,471.00	2.09
40	688226	威腾电气	8,569,119.63	2.09
41	600809	山西汾酒	8,541,573.00	2.08
42	600201	生物股份	8,513,162.00	2.08
43	600028	中国石化	8,360,238.00	2.04
44	002112	三变科技	8,356,485.00	2.04
45	300428	立中集团	8,330,787.00	2.03
46	603160	汇顶科技	8,245,554.88	2.01
47	600801	华新水泥	8,227,781.82	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 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600019	宝钢股份	19,316,495.00	4.71
2	002558	巨人网络	19,214,263.00	4.68
3	601058	赛轮轮胎	18,845,194.20	4.59
4	002236	大华股份	18,287,945.74	4.46
5	002271	东方雨虹	18,269,374.00	4.45
6	600312	平高电气	18,000,707.58	4.39
7	002555	三七互娱	15,942,721.80	3.89
8	600737	中粮糖业	15,640,934.00	3.81

9	000338	潍柴动力	15,002,349.00	3.66
10	002415	海康威视	14,467,976.00	3.53
11	605589	圣泉集团	14,017,563.00	3.42
12	603283	赛腾股份	13,601,762.16	3.32
13	688278	特宝生物	13,570,298.51	3.31
14	600519	贵州茅台	12,878,810.43	3.14
15	601800	中国交建	12,146,871.00	2.96
16	000651	格力电器	12,047,522.00	2.94
17	002641	公元股份	11,942,345.45	2.91
18	000333	美的集团	11,928,864.00	2.91
19	600025	华能水电	11,813,124.00	2.88
20	600867	通化东宝	11,173,745.54	2.72
21	601108	财通证券	11,093,979.00	2.70
22	601633	长城汽车	11,013,443.68	2.69
23	002969	嘉美包装	10,824,782.00	2.64
24	300922	天秦装备	10,713,790.22	2.61
25	002139	拓邦股份	10,528,696.00	2.57
26	000568	泸州老窖	10,215,006.00	2.49
27	601857	中国石油	10,000,508.00	2.44
28	003000	劲仔食品	9,729,421.36	2.37
29	300001	特锐德	9,664,445.00	2.36
30	002687	乔治白	9,476,010.71	2.31
31	300682	朗新集团	9,393,096.00	2.29
32	600801	华新水泥	9,339,594.01	2.28
33	601985	中国核电	9,285,244.00	2.26
34	601636	旗滨集团	9,257,891.00	2.26
35	301045	天禄科技	9,203,031.00	2.24
36	688226	威腾电气	9,186,688.29	2.24
37	002273	水晶光电	9,146,209.00	2.23
38	600938	中国海油	8,972,981.00	2.19
39	605318	法狮龙	8,789,450.00	2.14

40	603048	浙江黎明	8,748,845.00	2.13
41	300450	先导智能	8,687,999.00	2.12
42	000959	首钢股份	8,633,805.00	2.11
43	603992	松霖科技	8,560,928.00	2.09
44	300851	交大思诺	8,484,616.00	2.07
45	600201	生物股份	8,393,564.00	2.05
46	000157	中联重科	8,371,210.00	2.04
47	002112	三变科技	8,319,088.10	2.03
48	300870	欧陆通	8,238,483.46	2.01
49	300428	立中集团	8,230,706.00	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	2,970,756,428.96
卖出股票收入（成交）总额	2,993,240,626.46

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	18,921,078.58	5.34
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	18,921,078.58	5.34

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	019709	23国债16	80,300	8,155,389.00	2.30
2	019727	23国债24	68,000	6,923,694.79	1.96
3	019733	24国债02	30,000	3,032,192.05	0.86
4	019698	23国债05	8,000	809,802.74	0.23

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策
无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
无。

7.12 投资组合报告附注

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

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	12,592.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,592.25

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
博道 久航	3,0 97	48,685.57	49,258,410.07	32.6 7%	101,520,787.24	67.33%

混合A						
博道久航混合C	3,246	52,373.31	111,146,836.66	65.38%	58,856,931.54	34.62%
合计	6,220	51,572.82	160,405,246.73	50.00%	160,377,718.78	50.00%

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	博道久航混合A	829,276.62	0.55%
	博道久航混合C	70,380.72	0.04%
	合计	899,657.34	0.28%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	博道久航混合A	10~50
	博道久航混合C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	博道久航混合A	0~10
	博道久航混合C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道久航混合A	博道久航混合C
基金合同生效日(2019年12月24日)基金份额总额	1,054,254,547.59	874,773,338.47

本报告期期初基金份额总额	191,756,184.97	165,826,400.19
本报告期基金总申购份额	49,388,978.64	240,871,632.69
减：本报告期基金总赎回份额	90,365,966.30	236,694,264.68
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	150,779,197.31	170,003,768.20

注：

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

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：报告期内，经董事会审议通过，史伟先生不再担任公司副总经理。本公司已按规定将上述事项公告并报监管机构备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	5,962,321,813.40	100.00%	3,704,387.39	100.00%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
兴业证券	31,053,616.00	100.00%	37,502,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：

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

- (1) 本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
 (2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-12
2	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2024-01-22
3	博道久航混合型证券投资基金2023年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-22
4	博道基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-08
5	博道基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
6	博道久航混合型证券投资基金2023年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
7	博道基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2024-04-22
8	博道久航混合型证券投资基金2024年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-22
9	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人承销证券的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-29
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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司	2024-06-07

	身份信息资料的公告	网站、中国证监会基金电子披露网站	
11	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加国信证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-26
12	博道久航混合型证券投资基金产品资料概要更新	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-27

§11 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	20240527 - 20240528	33,152,258.47	38,205,608.66	71,357,867.13	-	-
	2	20240529 - 20240630	-	84,457,476.62	-	84,457,476.62	26.33%
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久航混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道久航混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道久航混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道久航混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道久航混合型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内博道久航混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

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

博道基金管理有限公司
二〇二四年八月三十日