

博道成长智航股票型证券投资基金

2025 年年度报告

2025 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:广发证券股份有限公司

送出日期:2026 年 03 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2026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2025年01月01日起至2025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	11
§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	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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§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	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61
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	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	77
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	103
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	104
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	104
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	104
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	104
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	104

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	104
8.12 投资组合报告附注.....	105
§9 基金份额持有人信息.....	105
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	105
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	106
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.....	106
§10 开放式基金份额变动.....	107
§11 重大事件揭示.....	107
11.1 基金份额持有人大会决议.....	107
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.....	107
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	107
11.4 基金投资策略的改变.....	108
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	108
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	108
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	108
11.8 其他重大事件.....	109
§12 备查文件目录.....	112
12.1 备查文件目录.....	112
12.2 存放地点.....	112
12.3 查阅方式.....	112

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道成长智航股票型证券投资基金	
基金简称	博道成长智航股票	
基金主代码	013641	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年10月26日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,448,121,181.96份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道成长智航股票A	博道成长智航股票C
下属分级基金的交易代码	013641	013642
报告期末下属分级基金的份额总额	1,621,690,539.59份	1,826,430,642.37份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注成长风格相关上市公司股票的投资机会，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金，重点关注成长风格相关上市公司股票的投资机会，选取中信成长风格指数为业绩比较基准中股票资产部分的基准指数，通过量化选股模型构建股票组合，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。首先，综合考虑股票的盈利情况、风险情况等因素，筛选出满足一定基本面要求的股票，构建备选股票池。然后，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。最后，利用投资组合优化工具，最大化组合的预期收益，以此来确定个股的投资权重，并根据市场的变化及时调整投资组合，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。本基金的股指期货投资策略、

	债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、参与融资业务的策略和存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中信成长风格指数收益率×90%+同期银行活期存款利率(税后)×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博道基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛	罗琦
	联系电话	021-80226288	020-66338888
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		400-085-2888	95575
传真		021-80226289	020-87553363-6847
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼
邮政编码		200122	510627
法定代表人		莫泰山	林传辉

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	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26
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	2025年		2024年		2023年	
	博道成长智航股票A	博道成长智航股票C	博道成长智航股票A	博道成长智航股票C	博道成长智航股票A	博道成长智航股票C
本期已实现收益	466,528,372.64	637,695,042.93	33,966,081.25	-52,087,911.07	46,433,595.91	32,956,925.47
本期利润	535,839,263.40	700,481,574.82	62,713,835.82	-92,595,919.06	110,650,924.15	65,472,143.13
加权平均基金份额本期利润	0.4779	0.4901	0.0542	-0.0723	0.0869	0.0418
本期加权平均净值利润率	37.63%	39.16%	6.56%	-8.89%	9.79%	4.75%
本期基金份额净值增长率	49.88%	49.14%	10.91%	10.35%	11.31%	10.76%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末		2024年末		2023年末	
期末可供分配利润	600,159,586.58	623,155,860.66	-30,689,123.25	-44,243,160.75	-158,182,893.76	-296,707,119.21
期末可供分配基金份额利润	0.3701	0.3412	-0.0373	-0.0527	-0.1107	-0.1203
期末基金资产净值	2,413,635,575.08	2,662,073,202.89	816,048,518.15	820,367,281.69	1,279,425,053.15	2,184,405,160.20
期末基金份额净值	1.4883	1.4575	0.9930	0.9773	0.8953	0.8856

3.1.3 累计期末指标	2025年末		2024年末		2023年末	
基金份额累计净值增长率	48.83%	45.75%	-0.70%	-2.27%	-10.47%	-11.44%

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

博道成长智航股票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	0.68%	1.27%	-0.12%	1.38%	0.80%	-0.11%
过去六个月	27.90%	1.25%	30.29%	1.34%	-2.39%	-0.09%
过去一年	49.88%	1.42%	39.34%	1.47%	10.54%	-0.05%
过去三年	85.04%	1.50%	42.45%	1.55%	42.59%	-0.05%
自基金合同生效起至今	48.83%	1.47%	12.89%	1.51%	35.94%	-0.04%

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。

博道成长智航股票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	0.55%	1.27%	-0.12%	1.38%	0.67%	-0.11%
过去六个月	27.58%	1.24%	30.29%	1.34%	-2.71%	-0.10%
过去一年	49.14%	1.42%	39.34%	1.47%	9.80%	-0.05%
过去三年	82.28%	1.50%	42.45%	1.55%	39.83%	-0.05%
自基金合同	45.75%	1.47%	12.89%	1.51%	32.86%	-0.04%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

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

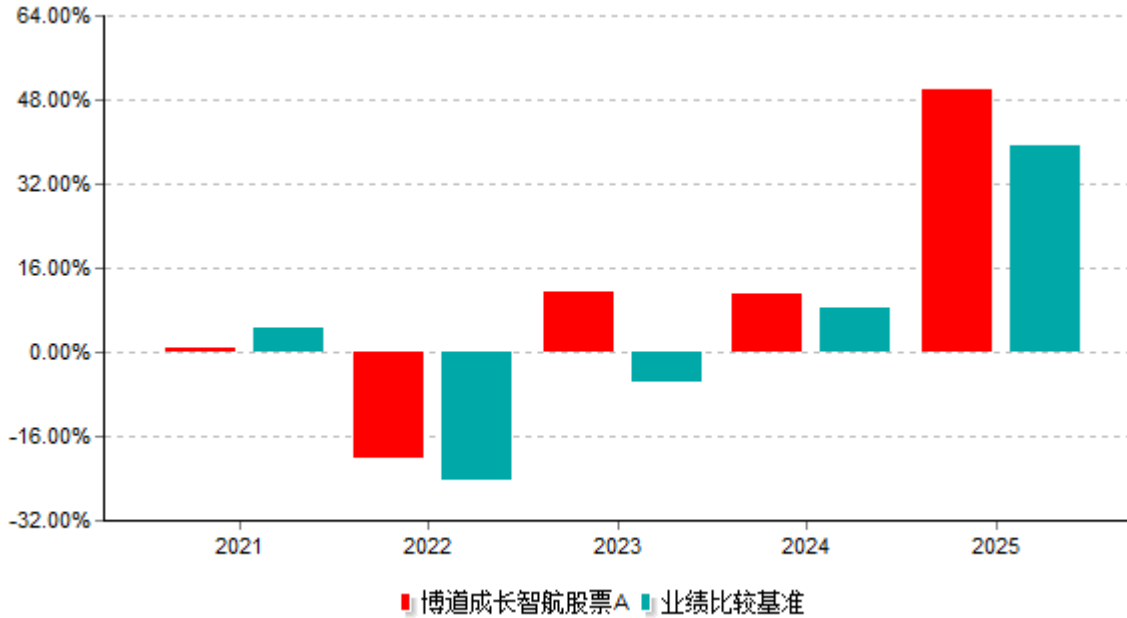


注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

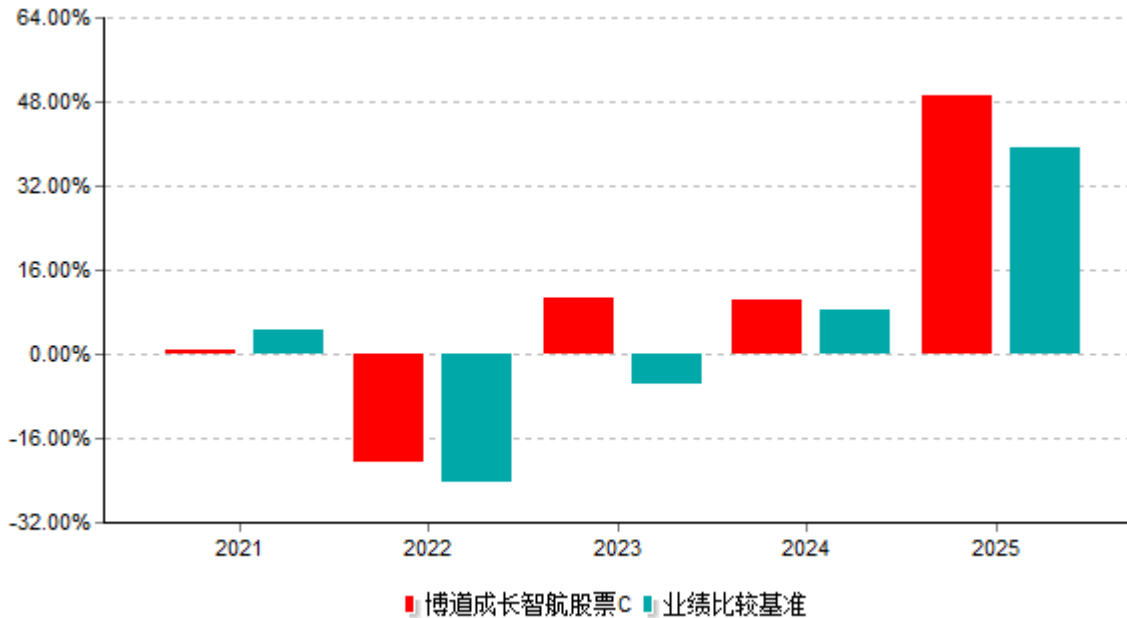


注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

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



注：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39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、博道明远混合型证券投资基金、博道和裕多元稳健30天持有期债券型证券投资基金、博道大盘成长股票型证券投资基金、博道大盘价值股票型证券投资基金、博道沪深300指数量化增强型证券投资基金、博道中证A500指数增强型证券投资基金、博道中证800指数增强型证券投资基金、博道和盈利率债债券型证券投资基金、博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金、博道中证全指指数增强型证券投资基金和博道惠泓价值成长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、博道伍佰智航、博道成长智航股票、博道中证1000指数增强、博道大盘成长股票、博道沪深300指数量化增强、博道中证A500指数增强、博道中证800指数增强、博道上证科创板综合指数增强、博道中证全指指数增强的基金经理、量化投资总监兼量化投资部总经理	2021-10-26	-	14年	杨梦女士，中国籍，经济学硕士。2011年7月至2014年6月担任农银汇理基金管理有限公司量化研究员，2014年6月至2014年11月担任华泰资产管理有限公司量化研究员，2014年11月至2017年7月担任上海博道投资管理有限公司投资经理助理、投资经理。2017年8月加入博道基金管理有限公司。具有基金从业资格。
----	---	------------	---	-----	---

注：1、对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离职日期"为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，"任职日期"和"离职日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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6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

2025年全年，在全球货币政策和财政政策均维持宽松、AI技术革命加速的背景下，权益资产表现较好。具体来看，沪深300上涨17.66%，中证500上涨30.39%，中证1000

上涨27.49%。从行业来看，有色、通信、电子涨幅居前，分别上涨96.91%、88.29%、44.93%；食品饮料、煤炭下跌，分别下跌6.64%、2.25%。

从因子层面来看，全年因子超额环境较好。成长风格强势，表征景气度的基本面类因子尤其是分析师预期类因子全年超额突出；受益于个股成交活跃，AI量价类因子也录得较好的超额收益；价值类因子总体承压。维持均衡配权的博道量化多因子模型，本年度总体上运作正常。研究层面，继续围绕传统框架多因子模型和AI全流程框架多因子模型进行深化，以及推动组合优化与风控模块持续升级迭代。

报告期间，本基金维持配置中信成长风格指数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2026年，从基本面的维度，作为“十五五”规划开局之年，中央经济工作会议对2026年政策定调仍然积极，预计2026年通胀形势有望出现企稳回升迹象，名义GDP将实现一定幅度的修复，增长的分担预计更加均衡，复苏的广度有望提升，对权益市场投资仍然友好；从估值的维度，考虑到权益市场整体估值已越过历史中位数，预计市场波动将加大。

本基金将继续坚持系统化投资的运作思路，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

本年度，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

本报告期内，本基金托管人在对博道成长智航股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉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

本报告期内，博道基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金托管人依法对博道基金管理有限公司编制和披露的博道成长智航股票型证券投资基金2025年年度报告中的财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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	容诚审字[2026]200Z0951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	博道成长智航股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了博道成长智航股票型证券投资基金（以下简称“博道成长智航股票基金”）财务报表，包括2025年12月31日的资产负债表，2025年

	<p>度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</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务操作编制，公允反映了博道成长智航股票基金2025年12月31日的财务状况以及2025年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
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。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于博道成长智航股票基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。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>
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>博道成长智航股票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成长智航股票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成</p>

	<p>长智航股票基金、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成长智航股票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。</p> <p>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：</p> <p>（1）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。</p> <p>（2）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。</p> <p>（3）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。</p> <p>（4）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，就可能对博道成长智航股票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</p>

	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成长智航股票基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报、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	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈迺迤	李隐煜
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26	
审计报告日期	2026-03-24	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博道成长智航股票型证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	191,650,102.92	56,663,028.25
结算备付金		4,924.81	4,854.46
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	4,930,758,162.46	1,635,026,766.90
其中：股票投资		4,665,399,690.67	1,547,168,805.28
基金投资		-	-
债券投资		265,358,471.79	87,857,961.62
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		38,487,412.79	2,942,422.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		5,160,900,602.98	1,694,637,072.21
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		77,745,804.33	55,561,274.81
应付管理人报酬		5,070,955.25	1,799,382.80
应付托管费		845,159.23	299,897.15
应付销售服务费		1,110,128.90	379,698.88
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3.62	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	419,773.68	181,018.73
负债合计		85,191,825.01	58,221,272.37
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	3,448,121,181.96	1,661,245,455.42

未分配利润	7.4.7.8	1,627,587,596.01	-24,829,655.58
净资产合计		5,075,708,777.97	1,636,415,799.84
负债和净资产总计		5,160,900,602.98	1,694,637,072.21

注：报告截止日2025年12月31日，A类基金份额净值1.4883元，C类基金份额净值1.4575元；基金份额总额3,448,121,181.96份，其中A类基金份额1,621,690,539.59份，C类基金份额1,826,430,642.37份。

7.2 利润表

会计主体：博道成长智航股票型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年01月01日至2 025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2 024年12月31日
一、营业总收入		1,290,217,007.00	3,479,807.49
1.利息收入		189,327.06	294,997.14
其中：存款利息收入	7.4.7.9	189,326.28	294,996.45
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		0.78	0.69
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,148,130,358.74	13,616,317.69
其中：股票投资收益	7.4.7.10	1,115,246,111.58	-13,586,644.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	2,857,029.74	2,248,897.12
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
收益		-	-
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	30,027,217.42	24,954,065.41
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	132,097,422.65	-11,760,253.42
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	9,799,898.55	1,328,746.08
减：二、营业总支出		53,896,168.78	33,361,890.73
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	38,366,962.61	23,960,331.30
2.托管费	7.4.10.2.2	6,394,493.77	3,993,388.62
3.销售服务费		8,900,458.29	5,206,408.36
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		34,253.17	21,762.07
其中：卖出回购金融资产支出		34,253.17	21,762.07
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		0.94	0.38
8.其他费用	7.4.7.17	200,000.00	180,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,236,320,838.22	-29,882,083.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,236,320,838.22	-29,882,083.24
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,236,320,838.22	-29,882,083.24

7.3 净资产变动表

会计主体：博道成长智航股票型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025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	1,661,245,455.42	-24,829,655.58	1,636,415,799.84
二、本期期初净资产	1,661,245,455.42	-24,829,655.58	1,636,415,799.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,786,875,726.54	1,652,417,251.59	3,439,292,978.13
（一）、综合收益总额	-	1,236,320,838.22	1,236,320,838.22
（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）	1,786,875,726.54	416,096,413.37	2,202,972,139.91
其中：1.基金申购款	5,787,652,961.21	1,557,402,366.56	7,345,055,327.77
2.基金赎回款	-4,000,777,234.67	-1,141,305,953.19	-5,142,083,187.86
（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	3,448,121,181.96	1,627,587,596.01	5,075,708,777.97
项目	上年度可比期间 2024年01月01日至2024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	3,895,685,108.37	-431,854,895.02	3,463,830,213.35
二、本期期初净资产	3,895,685,108.37	-431,854,895.02	3,463,830,213.35

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,234,439,652.95	407,025,239.44	-1,827,414,413.51
（一）、综合收益总额	-	-29,882,083.24	-29,882,083.24
（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）	-2,234,439,652.95	436,907,322.68	-1,797,532,330.27
其中：1.基金申购款	1,228,912,960.06	-190,428,896.81	1,038,484,063.25
2.基金赎回款	-3,463,352,613.01	627,336,219.49	-2,836,016,393.52
（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	1,661,245,455.42	-24,829,655.58	1,636,415,799.84

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

博道成长智航股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]2858号《关于准予博道成长智航股票型证券投资基金注册的批复》注册，由博道基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道成长智航股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币

2,792,493,565.87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（2021）第0983号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道成长智航股票型证券投资基金基金合同》于2021年10月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,793,373,426.14份基金份额，其中认购资金利息折合879,860.27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，基金托管人为广发证券股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道成长智航股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（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、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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信成长风格指数收益率×90%+同期银行活期存款利率(税后)×10%。

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2026年3月24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》、本基金合同和在财务报表附注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2025年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2025年12月31日的财务状况以及2025年度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。

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商业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商业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。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、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及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税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》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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，对除持有金融债券外的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。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。

(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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
活期存款	3,387,249.70	4,995,130.91
等于：本金	3,386,459.21	4,994,167.91
加：应计利息	790.49	963.00
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	188,262,853.22	51,667,897.34
等于：本金	188,252,016.18	51,662,747.73
加：应计利息	10,837.04	5,149.61
减：坏账准备	-	-
合计	191,650,102.92	56,663,028.25

注：其他存款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 2025年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	4,552,758,903.45	-	4,665,399,690.67	112,640,787.22	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	263,042,694.43	2,237,673.66	265,358,471.79	78,103.70
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	263,042,694.43	2,237,673.66	265,358,471.79	78,103.70
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	4,815,801,597.8	2,237,673.66	4,930,758,162.4	112,718,890.92	

		8		6	
项目		上年度末 2024年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,566,598,400.6 9	-	1,547,168,805.2 8	-19,429,595.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	86,904,736.32	902,161.62	87,857,961.62	51,063.68
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	86,904,736.32	902,161.62	87,857,961.62	51,063.68
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,653,503,137.0 1	902,161.62	1,635,026,766.9 0	-19,378,531.73

注：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(如有)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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	99,773.68	1,018.73
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	80,000.00	60,000.00
预提费用-信息披露费	240,000.00	120,000.00
合计	419,773.68	181,018.73

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 博道成长智航股票A

金额单位：人民币元

项目 (博道成长智航股票A)	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	821,807,418.39	821,807,418.39
本期申购	2,601,984,512.95	2,601,984,512.95
本期赎回（以“-”号填列）	-1,802,101,391.75	-1,802,101,391.75
本期末	1,621,690,539.59	1,621,690,539.59

7.4.7.7.2 博道成长智航股票C

金额单位：人民币元

项目 (博道成长智航股票C)	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	839,438,037.03	839,438,037.03
本期申购	3,185,668,448.26	3,185,668,448.26
本期赎回（以“-”号填列）	-2,198,675,842.92	-2,198,675,842.92

本期末	1,826,430,642.37	1,826,430,642.37
-----	------------------	------------------

注：

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

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 博道成长智航股票A

单位：人民币元

项目 (博道成长智航股票A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-30,689,123.25	24,930,223.01	-5,758,900.24
本期期初	-30,689,123.25	24,930,223.01	-5,758,900.24
本期利润	466,528,372.64	69,310,890.76	535,839,263.40
本期基金份额交易产生的变动数	164,320,337.19	97,544,335.14	261,864,672.33
其中：基金申购款	522,609,616.76	284,573,278.64	807,182,895.40
基金赎回款	-358,289,279.57	-187,028,943.50	-545,318,223.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	600,159,586.58	191,785,448.91	791,945,035.49

7.4.7.8.2 博道成长智航股票C

单位：人民币元

项目 (博道成长智航股票C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-44,243,160.75	25,172,405.41	-19,070,755.34
本期期初	-44,243,160.75	25,172,405.41	-19,070,755.34
本期利润	637,695,042.93	62,786,531.89	700,481,574.82
本期基金份额交易产生的变动数	29,703,978.48	124,527,762.56	154,231,741.04
其中：基金申购款	422,050,295.13	328,169,176.03	750,219,471.16
基金赎回款	-392,346,316.65	-203,641,413.47	-595,987,730.12
本期已分配利润	-	-	-

本期末	623,155,860.66	212,486,699.86	835,642,560.52
-----	----------------	----------------	----------------

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
活期存款利息收入	30,994.38	31,438.56
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	155,365.73	263,484.62
结算备付金利息收入	70.35	73.27
其他	2,895.82	-
合计	189,326.28	294,996.45

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
卖出股票成交总额	40,181,155,207.08	24,085,832,442.69
减：卖出股票成本总额	39,003,645,571.14	24,061,823,258.62
减：交易费用	62,263,524.36	37,595,828.91
买卖股票差价收入	1,115,246,111.58	-13,586,644.84

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 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
债券投资收益——利息收入	2,234,830.14	1,822,818.19
债券投资收益——买卖债券	622,199.60	426,078.93

（债转股及债券到期兑付） 差价收入		
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	2,857,029.74	2,248,897.12

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 2025年01月01日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	161,843,789.48	239,792,747.92
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	159,200,448.91	236,250,351.21
减：应计利息总额	2,019,075.92	3,114,748.12
减：交易费用	2,065.05	1,569.66
买卖债券差价收入	622,199.60	426,078.93

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 2025年01月01日至2025年	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年

	12月31日	12月31日
股票投资产生的股利收益	30,027,217.42	24,954,065.41
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	30,027,217.42	24,954,065.41

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12 月31日
1.交易性金融资产	132,097,422.65	-11,760,253.42
——股票投资	132,070,382.63	-11,612,238.10
——债券投资	27,040.02	-148,015.32
——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	132,097,422.65	-11,760,253.42

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
基金赎回费收入	9,692,686.20	1,219,179.84
转换费收入	107,212.35	109,566.24
合计	9,799,898.55	1,328,746.08

注：

- 1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产；
- 2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

具体以本基金最新的招募说明书为准。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
审计费用	80,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	200,000.00	180,000.00

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
广发证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
上海博道投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海博道如思投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
上海博道如见投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
上海博道如舍投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
上海博道如知投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
上海博道相形投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
莫泰山	基金管理人的股东

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；
2、根据博道基金管理有限公司(以下简称"博道基金")股东会决议，经中国证监会《关于核准博道基金管理有限公司变更持股5%以上股东的批复》（证监许可〔2025〕473号）批准，史伟将持有的占比3%博道基金股权转让于杨梦。博道基金于2025年5月13日完成了工商变更登记手续。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31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
广发证券股份有限公司	54,465,805,664.47	66.29%	20,335,262,792.04	43.71%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	245,251,548.02	62.77%	123,837,595.00	40.72%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31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
广发证券 股份有限 公司	286,409,000.00	50.59%	80,604,000.00	36.86%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31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
广发证券 股份有限 公司	24,835,053.12	67.28%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31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
广发证券 股份有限	9,893,255.10	43.83%	-	-

公司				
----	--	--	--	--

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。

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 2025年01月01日至20 25年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	38,366,962.61	23,960,331.30
其中：应支付销售机构的客户维护费	11,968,158.09	7,264,243.58
应支付基金管理人的净管理费	26,398,804.52	16,696,087.72

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,394,493.77	3,993,388.62

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值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。

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 2025年01月01日至2025年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道成长智航股票A	博道成长智航股票C	合计

博道基金管理有限公司	-	1,774,447.10	1,774,447.10
广发证券股份有限公司	-	1,386,333.97	1,386,333.97
合计	-	3,160,781.07	3,160,781.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道成长智航股票A	博道成长智航股票C	合计
博道基金管理有限公司	-	1,327,299.05	1,327,299.05
广发证券股份有限公司	-	961,564.13	961,564.13
合计	-	2,288,863.18	2,288,863.18

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×该日适用费率/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

博道成长智航股票A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2025年01月01日至 2025年12月31日	2024年01月01日至 2024年12月31日

报告期初持有的基金份额	5,205,376.24	5,205,376.24
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	4,500,000.00	-
报告期末持有的基金份额	705,376.24	5,205,376.24
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.04%	0.63%

博道成长智航股票C

份额单位：份

项目	本期 2025年01月01日至 2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至 2024年12月31日
报告期初持有的基金份额	1,000,540.00	1,000,540.00
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	1,000,540.00	1,000,540.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.05%	0.12%

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

上海博道投资管理有限公司及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为大于100万份。（上年度末，上海博道投资管理有限公司及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为大于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 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司	118,333,928.72	43,611.92	27,919,656.24	140,949.84

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。

7.4.10.6 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 2025年01月01日至2025年12月31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
广发证券股份有限公司	001382	新亚电缆	网下发行	3,660	27,084.00
广发证券股份有限公司	301662	宏工科技	网下发行	1,429	38,011.40
广发证券股份有限公司	688795	摩尔线程	网下发行	5,156	589,227.68
广发证券股份有限公司	688805	健信超导	网下发行	2,643	49,106.94
上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31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

广发证券 股份有限 公司	301556	托普云农	网下发行	2,663	38,613.50
--------------------	--------	------	------	-------	-----------

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（2025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
688802	沐曦股份	2025-12-09	6个月以上	科创板打新限售	104.66	399.40	3,994	418,012.04	1,595,203.60	-
600930	华电新能	2025-07-09	6个月以上	主板打新限售	3.18	6.24	181,825	578,203.50	1,134,588.00	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	6个月以上	科创板打新限售	114.28	416.18	2,321	265,243.88	965,953.78	-
688783	西安奕材	2025-10-20	6个月以上	科创板打新限售	8.62	18.36	14,790	127,489.80	271,544.40	-
301656	联合动力	2025-09-17	6个月以上	创业板打新限售	12.48	25.46	7,395	92,289.60	188,276.70	-

688765	禾元生物	2025-10-16	6个月以上	科创板打新限售	29.06	52.62	3,529	102,552.74	185,695.98	-
001280	中国铀业	2025-11-25	6个月以上	主板打新限售	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-
688729	屹唐股份	2025-07-01	6个月以上	科创板打新限售	8.45	24.28	3,505	29,617.25	85,101.40	-
688759	必贝特	2025-10-21	6个月以上	科创板打新限售	17.78	25.11	2,789	49,588.42	70,031.79	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	6个月以上	科创板打新限售	83.06	117.19	516	42,858.96	60,470.04	-
688809	强一股份	2025-12-23	6个月以上	科创板打新限售	85.09	203.31	259	22,038.31	52,657.29	-
301638	南网数字	2025-11-11	6个月以上	创业板打新限售	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-
001386	马可波罗	2025-10-15	6个月以上	主板打新限售	13.75	18.53	1,626	22,357.50	30,129.78	-
688727	恒坤新材	2025-11-11	6个月以上	科创板打新限售	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
001233	海安集团	2025-11-18	6个月以上	主板打新限售	48.00	51.88	370	17,760.00	19,195.60	-
688796	百奥赛图	2025-12-02	6个月以上	科创板打新限售	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688807	优迅股份	2025-12-10	6个月以上	科创板打新限售	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-

301 632	广东 建科	2025- 08-05	6个月以 上	创业板 打新限 售	6.56	23.6 8	656	4,303. 36	15,53 4.08	-
301 563	云汉 芯城	2025- 09-23	6个月以 上	创业板 打新限 售	27.0 0	133. 69	110	2,970. 00	14,70 5.90	-
301 491	汉桑 科技	2025- 07-29	6个月以 上	创业板 打新限 售	28.9 1	55.1 1	245	7,082. 95	13,50 1.95	-
301 584	建发 致新	2025- 09-18	6个月以 上	创业板 打新限 售	7.05	26.8 2	447	3,151. 35	11,98 8.54	-
001 369	双欣 环保	2025- 12-23	6个月以 上	主板打 新限售	6.85	12.8 9	897	6,144. 45	11,56 2.33	-
301 609	山大 电力	2025- 07-16	6个月以 上	创业板 打新限 售	14.6 6	40.9 9	277	4,060. 82	11,35 4.23	-
301 687	新广 益	2025- 12-24	6个月以 上	创业板 打新限 售	21.9 3	54.3 9	195	4,276. 35	10,60 6.05	-
001 221	悍高 集团	2025- 07-23	6个月以 上	主板打 新限售	15.4 3	56.9 4	160	2,468. 80	9,110. 40	-
301 667	纳百 川	2025- 12-10	6个月以 上	创业板 打新限 售	22.6 3	57.0 7	151	3,417. 13	8,617. 57	-
688 805	健信 超导	2025- 12-17	6个月以 上	科创板 打新限 售	18.5 8	32.3 7	265	4,923. 70	8,578. 05	-
603 418	友升 股份	2025- 09-16	6个月以 上	主板打 新限售	46.3 6	59.0 6	139	6,444. 04	8,209. 34	-
603 175	超颖 电子	2025- 10-17	6个月以 上	主板打 新限售	17.0 8	48.5 6	169	2,886. 52	8,206. 64	-
603	德力	2025-	6个月以	主板打	46.6	55.6	146	6,815.	8,126.	-

092	佳	10-30	上	新限售	8	6		28	36	
001 285	瑞立 科密	2025- 09-23	6个月以 上	主板打 新限售	42.2 8	56.0 8	137	5,792. 36	7,682. 96	-
301 668	昊创 瑞通	2025- 09-15	6个月以 上	创业板 打新限 售	21.0 0	44.8 0	165	3,465. 00	7,392. 00	-
301 449	天溯 计量	2025- 12-16	6个月以 上	创业板 打新限 售	36.8 0	65.2 3	112	4,121. 60	7,305. 76	-
601 026	道生 天合	2025- 10-09	6个月以 上	主板打 新限售	5.98	14.2 8	451	2,696. 98	6,440. 28	-
301 575	艾芬 达	2025- 09-03	6个月以 上	创业板 打新限 售	27.6 9	49.5 5	126	3,488. 94	6,243. 30	-
603 406	天富 龙	2025- 07-30	6个月以 上	主板打 新限售	23.6 0	40.1 6	153	3,610. 80	6,144. 48	-
603 262	技源 集团	2025- 07-16	6个月以 上	主板打 新限售	10.8 8	28.1 0	155	1,686. 40	4,355. 50	-
603 248	锡华 科技	2025- 12-16	6个月以 上	主板打 新限售	10.1 0	16.3 0	260	2,626. 00	4,238. 00	-
001 388	信通 电子	2025- 06-24	6个月以 上	主板打 新限售	16.4 2	42.9 4	94	1,543. 48	4,036. 36	-
603 370	华新 精科	2025- 08-27	6个月以 上	主板打 新限售	18.6 0	46.3 5	82	1,525. 20	3,800. 70	-
603 376	大明 电子	2025- 10-28	6个月以 上	主板打 新限售	12.5 5	26.2 1	111	1,393. 05	2,909. 31	-
603 334	丰倍 生物	2025- 10-29	6个月以 上	主板打 新限售	24.4 9	32.8 2	88	2,155. 12	2,888. 16	-
001 396	誉帆 科技	2025- 12-23	6个月以 上	主板打 新限售	22.2 9	35.3 9	69	1,538. 01	2,441. 91	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证 券	证 券 名 称	成 功 认 购	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购	期 末	数 量 (单	期 末 成 本	期 末 估 值	备 注

代码		日			价格	估值单价	位：张)	总额	总额	
111024	澳弘转债	2025-12-12	1-6个月(含)	配债未上市	100.00	100.01	13,540	1,353,988.13	1,354,112.77	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项	78.81	2026-01-15	86.69	80,000	6,125,512.00	6,304,800.00	-

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广发证券开立于中国工商银行股份有限公司的托管账户，其他存款存放于方正证券股份有限公司、广发证券股份有限公司和国泰海通证券股份有限公司，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2025年12月31日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.03%(于2024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2025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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注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2025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0.25%。

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2025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5,070,328,111.80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 2025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	191,650,102.92	-	-	-	-	-	191,650,102.92
结算备付金	4,924.81	-	-	-	-	-	4,924.81
交易性金融资产	10,516,012.71	-	253,488,346.31	-	1,354,112.77	4,665,399,690.67	4,930,758,162.46
应收申购款	-	-	-	-	-	38,487,412.79	38,487,412.79
资产总计	202,171,040.44	-	253,488,346.31	-	1,354,112.77	4,703,887,103.46	5,160,900,602.98
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	77,745,804.33	77,745,804.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,070,955.25	5,070,955.25
应付托管费	-	-	-	-	-	845,159.23	845,159.23
应付销售服务	-	-	-	-	-	1,110,128.90	1,110,128.90

费							
应交税费	-	-	-	-	-	3.62	3.62
其他负债	-	-	-	-	-	419,773.68	419,773.68
负债总计	-	-	-	-	-	85,191,825.01	85,191,825.01
利率敏感度缺口	202,171,040.44	-	253,488,346.31	-	1,354,112.77	4,618,695,278.45	5,075,708,777.97
上年度末 2024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	56,663,028.25	-	-	-	-	-	56,663,028.25
结算备付金	4,854.46	-	-	-	-	-	4,854.46
交易性金融资产	-	6,435,450.00	81,422,511.62	-	-	1,547,168,805.28	1,635,026,766.90
应收申购款	-	-	-	-	-	2,942,422.60	2,942,422.60
资产总计	56,667,882.71	6,435,450.00	81,422,511.62	-	-	1,550,111,227.88	1,694,637,072.21
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	55,561,274.81	55,561,274.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,799,382.80	1,799,382.80
应付托管费	-	-	-	-	-	299,897.15	299,897.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-	379,698.88	379,698.88
其他负债	-	-	-	-	-	181,018.73	181,018.73
负债总计	-	-	-	-	-	58,221,272.37	58,221,272.37

利率敏感度缺口	56,667,882.71	6,435,450.00	81,422,511.62	-	-	1,491,889,955.51	1,636,415,799.84
---------	---------------	--------------	---------------	---	---	------------------	------------------

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2025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%(2024年12月31日：5.37%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2024年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产不低于基金资产的80%，保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024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	4,665,399,690.67	91.92	1,547,168,805.28	94.55
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	4,665,399,690.67	91.92	1,547,168,805.28	94.55

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中信成长风格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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
	1.中信成长风格指数收益率 上升5%	246,742,682.94	67,001,036.33
	2.中信成长风格指数收益率 下降5%	-246,742,682.94	-67,001,036.33

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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	4,654,038,519.89	1,546,535,283.92
第二层次	271,663,271.79	87,885,698.12
第三层次	5,056,370.78	605,784.86
合计	4,930,758,162.46	1,635,026,766.90

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 2025年01月01日至2025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	-	605,784.86	605,784.86
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,144,874.19	2,144,874.19

转出第三层次	-	1,329,365.90	1,329,365.90
当期利得或损失总额	-	3,635,077.63	3,635,077.63
其中：计入损益的利得或损失	-	3,635,077.63	3,635,077.63
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	5,056,370.78	5,056,370.78
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	-	3,113,330.91	3,113,330.91
项目	上年度可比期间 2024年01月01日至2024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	-	1,323,364.19	1,323,364.19
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	501,517.68	501,517.68
转出第三层次	-	1,610,588.87	1,610,588.87
当期利得或损失总额	-	391,491.86	391,491.86
其中：计入损益的利得或损失	-	391,491.86	391,491.86
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	605,784.86	605,784.86
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	-	366,186.17	366,186.17

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	5,056,370.78	平均价格亚式期权模型	预期波动率	16.28%-30 3.23%	负相关
项目	上年度末公允价值	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	605,784.86	平均价格亚式期权模型	预期波动率	26.65%-57 4.44%	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

无。

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	4,665,399,690.67	90.40
	其中：股票	4,665,399,690.67	90.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	265,358,471.79	5.14

	其中：债券	265,358,471.79	5.14
	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	191,655,027.73	3.71
8	其他各项资产	38,487,412.79	0.75
9	合计	5,160,900,602.98	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	125,366,180.82	2.47
C	制造业	3,687,305,683.28	72.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,439,841.00	0.54
E	建筑业	716,266.00	0.01
F	批发和零售业	4,249,164.44	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	58,974,442.00	1.16
H	住宿和餐饮业	5,157,802.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	566,416,430.29	11.16
J	金融业	66,390,516.00	1.31
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	26,720,263.65	0.53
M	科学研究和技术服务业	66,992,986.58	1.32
N	水利、环境和公共设施管理业	4,176,985.10	0.08

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	25,493,129.51	0.50
S	综合	-	-
	合计	4,665,399,690.67	91.92

8.2.2 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

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	300750	宁德时代	559,716	205,561,298.16	4.05
2	002475	立讯精密	1,631,700	92,533,707.00	1.82
3	300502	新易盛	212,908	91,737,799.04	1.81
4	300308	中际旭创	124,700	76,067,000.00	1.50
5	688008	澜起科技	454,108	53,493,922.40	1.05
6	300014	亿纬锂能	810,800	53,318,208.00	1.05
7	002916	深南电路	205,759	47,795,758.11	0.94
8	601138	工业富联	730,300	45,315,115.00	0.89
9	002625	光启技术	917,410	44,732,911.60	0.88
10	002074	国轩高科	1,130,742	44,223,319.62	0.87
11	002517	恺英网络	1,940,700	42,443,109.00	0.84
12	002222	福晶科技	716,077	40,343,778.18	0.79
13	300496	中科创达	584,700	39,467,250.00	0.78
14	002414	高德红外	2,665,500	39,102,885.00	0.77
15	002600	领益智造	2,509,200	38,992,968.00	0.77
16	688772	珠海冠宇	1,803,882	38,837,579.46	0.77

17	301606	绿联科技	648,057	38,066,868.18	0.75
18	301316	慧博云通	851,685	38,053,285.80	0.75
19	002402	和而泰	968,114	37,872,619.68	0.75
20	002851	麦格米特	419,903	37,820,663.21	0.75
21	688182	灿勤科技	1,269,200	37,466,784.00	0.74
22	300491	通合科技	1,450,150	36,442,269.50	0.72
23	603590	康辰药业	912,700	36,279,825.00	0.71
24	300602	飞荣达	1,088,873	36,107,028.68	0.71
25	600967	内蒙一机	2,130,100	35,785,680.00	0.71
26	002273	水晶光电	1,405,200	35,298,624.00	0.70
27	603920	世运电路	721,112	34,909,031.92	0.69
28	300033	同花顺	108,300	34,892,094.00	0.69
29	603259	药明康德	382,950	34,710,588.00	0.68
30	301391	卡莱特	399,608	33,906,738.80	0.67
31	301095	广立微	472,300	33,868,633.00	0.67
32	688519	南亚新材	418,000	33,799,480.00	0.67
33	601869	长飞光纤	290,100	33,756,036.00	0.67
34	002281	光迅科技	469,900	32,869,505.00	0.65
35	300389	艾比森	2,011,755	32,650,783.65	0.64
36	603993	洛阳钼业	1,586,600	31,732,000.00	0.63
37	605099	共创草坪	887,556	31,676,873.64	0.62
38	300921	南凌科技	1,377,880	31,649,903.60	0.62
39	301626	苏州天脉	168,520	31,395,276.00	0.62
40	300428	立中集团	1,331,770	31,096,829.50	0.61
41	000657	中钨高新	1,105,900	30,644,489.00	0.60
42	603236	移远通信	319,200	30,454,872.00	0.60
43	000823	超声电子	2,193,700	29,746,572.00	0.59
44	603678	火炬电子	836,086	29,530,557.52	0.58
45	688256	寒武纪	21,784	29,529,301.20	0.58
46	300136	信维通信	469,700	29,121,400.00	0.57
47	301157	华塑科技	548,598	28,538,067.96	0.56

48	300550	和仁科技	1,961,017	28,454,356.67	0.56
49	002415	海康威视	941,429	28,092,241.36	0.55
50	688390	固德威	447,967	27,832,189.71	0.55
51	603659	璞泰来	1,002,020	27,395,226.80	0.54
52	300413	芒果超媒	1,113,400	27,189,228.00	0.54
53	300939	秋田微	784,440	27,047,491.20	0.53
54	600570	恒生电子	896,636	27,033,575.40	0.53
55	300813	泰林生物	1,097,370	26,962,380.90	0.53
56	300604	长川科技	266,000	26,948,460.00	0.53
57	688322	奥比中光	300,461	26,942,337.87	0.53
58	601872	招商轮船	2,967,100	26,644,558.00	0.52
59	603979	金诚信	348,134	26,510,404.10	0.52
60	000977	浪潮信息	391,100	26,047,260.00	0.51
61	300932	三友联众	2,160,128	25,899,934.72	0.51
62	002008	大族激光	625,700	25,772,583.00	0.51
63	688385	复旦微电	348,800	25,706,560.00	0.51
64	300321	同大股份	564,900	25,578,672.00	0.50
65	688138	清溢光电	904,681	25,475,816.96	0.50
66	300154	瑞凌股份	2,554,300	25,159,855.00	0.50
67	002602	世纪华通	1,455,400	24,829,124.00	0.49
68	600487	亨通光电	1,000,400	24,739,892.00	0.49
69	002837	英维克	228,881	24,465,090.09	0.48
70	000725	京东方 A	5,787,600	24,365,796.00	0.48
71	300274	阳光电源	141,165	24,144,861.60	0.48
72	688288	鸿泉技术	890,052	23,862,294.12	0.47
73	002265	建设工业	864,400	23,183,208.00	0.46
74	300124	汇川技术	303,435	22,857,758.55	0.45
75	300806	斯迪克	728,200	22,384,868.00	0.44
76	605058	澳弘电子	729,373	22,260,463.96	0.44
77	300852	四会富仕	578,724	22,095,682.32	0.44
78	600026	中远海能	1,839,300	21,483,024.00	0.42

79	300984	金沃股份	249,792	21,202,344.96	0.42
80	600276	恒瑞医药	354,861	21,139,069.77	0.42
81	688041	海光信息	94,092	21,115,185.72	0.42
82	688002	睿创微纳	207,610	20,927,088.00	0.41
83	600549	厦门钨业	505,700	20,764,042.00	0.41
84	688025	杰普特	139,499	19,748,873.43	0.39
85	002404	嘉欣丝绸	2,808,000	19,684,080.00	0.39
86	300452	山河药辅	1,416,871	18,957,733.98	0.37
87	601899	紫金矿业	548,300	18,899,901.00	0.37
88	300047	天源迪科	1,500,400	18,830,020.00	0.37
89	603016	新宏泰	609,200	18,349,104.00	0.36
90	600933	爱柯迪	902,800	18,146,280.00	0.36
91	000733	振华科技	344,000	18,029,040.00	0.36
92	002396	星网锐捷	594,700	18,019,410.00	0.36
93	300720	海川智能	528,900	17,924,421.00	0.35
94	688507	索辰科技	175,200	17,570,808.00	0.35
95	002811	郑中设计	1,182,100	17,542,364.00	0.35
96	603893	瑞芯微	97,200	17,328,816.00	0.34
97	688049	炬芯科技	323,232	17,002,003.20	0.33
98	688778	厦钨新能	215,469	16,670,836.53	0.33
99	300275	梅安森	1,250,700	16,646,817.00	0.33
100	001359	平安电工	233,469	16,576,299.00	0.33
101	000063	中兴通讯	435,300	16,471,752.00	0.32
102	000810	创维数字	1,386,200	16,329,436.00	0.32
103	002324	普利特	1,017,900	16,276,221.00	0.32
104	603256	宏和科技	424,400	15,622,164.00	0.31
105	600309	万华化学	198,460	15,217,912.80	0.30
106	300378	鼎捷数智	332,400	15,044,424.00	0.30
107	601877	正泰电器	532,800	14,859,792.00	0.29
108	002195	岩山科技	2,066,800	14,653,612.00	0.29
109	300687	赛意信息	636,916	14,629,960.52	0.29

110	688551	科威尔	390,709	14,389,812.47	0.28
111	603507	振江股份	545,500	14,352,105.00	0.28
112	600850	电科数字	483,700	14,336,868.00	0.28
113	300991	创益通	337,300	14,227,314.00	0.28
114	001313	粤海饲料	1,871,300	13,697,916.00	0.27
115	300454	深信服	117,700	13,554,332.00	0.27
116	688981	中芯国际	104,640	12,852,931.20	0.25
117	301031	中熔电气	113,600	12,744,784.00	0.25
118	603986	兆易创新	59,300	12,705,025.00	0.25
119	688610	埃科光电	204,394	12,633,593.14	0.25
120	301536	星宸科技	209,700	12,563,127.00	0.25
121	301128	强瑞技术	123,694	12,481,961.54	0.25
122	603948	建业股份	447,860	12,226,578.00	0.24
123	688661	和林微纳	235,200	12,173,952.00	0.24
124	688362	甬矽电子	374,912	12,150,897.92	0.24
125	600826	兰生股份	1,151,477	12,136,567.58	0.24
126	300777	中简科技	295,000	12,036,000.00	0.24
127	002345	潮宏基	962,200	12,027,500.00	0.24
128	688702	盛科通信	84,000	11,901,960.00	0.23
129	603063	禾望电气	352,900	11,670,403.00	0.23
130	600019	宝钢股份	1,527,800	11,382,110.00	0.22
131	600626	申达股份	2,349,600	11,348,568.00	0.22
132	301511	德福科技	307,313	10,998,732.27	0.22
133	002378	章源钨业	773,830	10,972,909.40	0.22
134	301186	超达装备	223,579	10,856,996.24	0.21
135	002859	洁美科技	384,609	10,615,208.40	0.21
136	002976	瑞玛精密	377,800	10,589,734.00	0.21
137	300709	精研科技	224,400	10,582,704.00	0.21
138	688088	虹软科技	212,804	10,533,798.00	0.21
139	603999	读者传媒	1,497,500	10,527,425.00	0.21
140	688678	福立旺	423,734	10,245,888.12	0.20

141	603341	龙旗科技	239,188	10,108,084.88	0.20
142	600372	中航机载	743,534	9,978,226.28	0.20
143	002558	巨人网络	226,200	9,792,198.00	0.19
144	002981	朝阳科技	341,600	9,759,512.00	0.19
145	603966	法兰泰克	815,100	9,699,690.00	0.19
146	301611	珂玛科技	110,900	9,507,457.00	0.19
147	688618	三旺通信	355,489	9,477,336.74	0.19
148	603897	长城科技	346,100	9,413,920.00	0.19
149	688612	威迈斯	282,542	9,315,409.74	0.18
150	688111	金山办公	30,199	9,273,206.93	0.18
151	300407	凯发电气	818,969	9,270,729.08	0.18
152	300450	先导智能	184,700	9,231,306.00	0.18
153	002357	富临运业	850,700	9,119,504.00	0.18
154	301185	鸥玛软件	473,996	9,053,323.60	0.18
155	300263	隆华科技	1,001,200	8,850,608.00	0.17
156	601003	柳钢股份	1,734,000	8,722,020.00	0.17
157	300559	佳发教育	674,821	8,509,492.81	0.17
158	688668	鼎通科技	67,400	8,357,600.00	0.16
159	000426	兴业银锡	234,600	8,351,760.00	0.16
160	603296	华勤技术	91,600	8,311,784.00	0.16
161	601137	博威合金	388,919	8,311,199.03	0.16
162	301388	欣灵电气	264,400	8,032,472.00	0.16
163	301052	果麦文化	209,229	7,990,455.51	0.16
164	301279	金道科技	227,800	7,881,880.00	0.16
165	300872	天阳科技	381,636	7,846,436.16	0.15
166	600796	钱江生化	1,280,000	7,756,800.00	0.15
167	601601	中国太保	180,800	7,577,328.00	0.15
168	301308	江波龙	30,865	7,556,986.60	0.15
169	300940	南极光	263,600	7,502,056.00	0.15
170	300897	山科智能	291,400	7,494,808.00	0.15
171	002463	沪电股份	102,000	7,453,140.00	0.15

172	300779	惠城环保	57,200	7,442,292.00	0.15
173	300850	新强联	179,100	7,409,367.00	0.15
174	002918	蒙娜丽莎	514,425	7,320,267.75	0.14
175	600114	东睦股份	235,620	7,198,191.00	0.14
176	603699	纽威股份	132,900	6,906,813.00	0.14
177	688153	唯捷创芯	183,168	6,894,443.52	0.14
178	601066	中信建投	257,100	6,882,567.00	0.14
179	300034	钢研高纳	341,240	6,681,479.20	0.13
180	300790	宇瞳光学	221,500	6,625,065.00	0.13
181	300416	苏试试验	369,600	6,593,664.00	0.13
182	601988	中国银行	1,142,600	6,547,098.00	0.13
183	002901	大博医疗	138,000	6,537,060.00	0.13
184	300435	中泰股份	293,800	6,528,236.00	0.13
185	000603	盛达资源	210,400	6,513,984.00	0.13
186	002027	分众传媒	882,700	6,505,499.00	0.13
187	688099	晶晨股份	74,200	6,472,466.00	0.13
188	301217	铜冠铜箔	188,100	6,448,068.00	0.13
189	301106	骏成科技	214,026	6,371,554.02	0.13
190	002049	紫光国微	80,000	6,304,800.00	0.12
191	300113	顺网科技	311,000	6,294,640.00	0.12
192	300105	龙源技术	866,800	6,206,288.00	0.12
193	002978	安宁股份	186,600	6,167,130.00	0.12
194	688127	蓝特光学	159,286	6,130,918.14	0.12
195	301110	青木科技	92,000	6,088,560.00	0.12
196	601088	中国神华	144,500	5,852,250.00	0.12
197	600391	航发科技	157,400	5,839,540.00	0.12
198	688800	瑞可达	69,400	5,760,200.00	0.11
199	688300	联瑞新材	91,282	5,667,699.38	0.11
200	300224	正海磁材	365,100	5,644,446.00	0.11
201	603121	华培动力	262,800	5,560,848.00	0.11
202	688116	天奈科技	115,600	5,450,540.00	0.11

203	002824	和胜股份	276,124	5,356,805.60	0.11
204	688321	微芯生物	181,600	5,306,352.00	0.10
205	688720	艾森股份	75,200	5,292,576.00	0.10
206	601991	大唐发电	1,505,800	5,255,242.00	0.10
207	300073	当升科技	90,900	5,254,020.00	0.10
208	600028	中国石化	831,500	5,138,670.00	0.10
209	300145	南方泵业	1,083,000	5,111,760.00	0.10
210	688372	伟测科技	46,800	5,105,412.00	0.10
211	002241	歌尔股份	173,600	4,987,528.00	0.10
212	000783	长江证券	607,000	4,947,050.00	0.10
213	603489	八方股份	161,584	4,941,238.72	0.10
214	300018	中元股份	448,900	4,937,900.00	0.10
215	002148	北纬科技	554,000	4,930,600.00	0.10
216	301589	诺瓦星云	29,804	4,904,248.20	0.10
217	688333	铂力特	43,600	4,861,836.00	0.10
218	600498	烽火通信	149,400	4,792,752.00	0.09
219	688259	创耀科技	111,800	4,673,240.00	0.09
220	002826	易明医药	250,700	4,607,866.00	0.09
221	002236	大华股份	242,700	4,596,738.00	0.09
222	300920	润阳科技	98,900	4,556,323.00	0.09
223	002861	瀛通通讯	255,800	4,550,682.00	0.09
224	301121	紫建电子	111,175	4,429,212.00	0.09
225	688689	银河微电	153,238	4,348,894.44	0.09
226	301328	维峰电子	90,200	4,290,814.00	0.08
227	688639	华恒生物	131,063	4,270,032.54	0.08
228	300972	万辰集团	21,000	4,222,470.00	0.08
229	603200	上海洗霸	58,715	4,176,985.10	0.08
230	300654	世纪天鸿	418,100	4,143,371.00	0.08
231	600965	福成股份	688,600	4,097,170.00	0.08
232	301008	宏昌科技	116,500	4,019,250.00	0.08
233	300219	鸿利智汇	548,600	3,955,406.00	0.08

234	000967	盈峰环境	534,400	3,922,496.00	0.08
235	300375	鹏翎股份	729,800	3,838,748.00	0.08
236	600150	中国船舶	114,187	3,797,859.62	0.07
237	300017	网宿科技	367,398	3,765,829.50	0.07
238	301526	国际复材	537,800	3,764,600.00	0.07
239	301073	君亭酒店	139,600	3,637,976.00	0.07
240	603267	鸿远电子	66,700	3,630,481.00	0.07
241	600547	山东黄金	93,700	3,627,127.00	0.07
242	002026	山东威达	230,600	3,470,530.00	0.07
243	301132	满坤科技	100,300	3,339,990.00	0.07
244	300111	向日葵	544,800	3,339,624.00	0.07
245	603577	汇金通	311,400	3,275,928.00	0.06
246	001286	陕西能源	348,400	3,243,604.00	0.06
247	605123	派克新材	31,100	3,231,290.00	0.06
248	601958	金钼股份	206,700	3,220,386.00	0.06
249	300465	高伟达	159,100	3,202,683.00	0.06
250	300882	万胜智能	169,800	3,192,240.00	0.06
251	688708	佳驰科技	50,000	3,112,500.00	0.06
252	300303	聚飞光电	442,800	3,028,752.00	0.06
253	001203	大中矿业	98,200	3,009,830.00	0.06
254	603206	嘉环科技	171,277	2,961,379.33	0.06
255	000049	德赛电池	107,400	2,886,912.00	0.06
256	603859	能科科技	67,900	2,855,195.00	0.06
257	002849	威星智能	178,900	2,844,510.00	0.06
258	600100	同方股份	317,900	2,835,668.00	0.06
259	688700	东威科技	80,000	2,822,400.00	0.06
260	300515	三德科技	143,496	2,821,131.36	0.06
261	601168	西部矿业	98,700	2,728,068.00	0.05
262	603306	华懋科技	42,400	2,671,624.00	0.05
263	688663	新风光	68,800	2,667,376.00	0.05
264	300048	合康新能	443,700	2,640,015.00	0.05

265	301413	安培龙	19,431	2,619,298.80	0.05
266	000975	山金国际	107,500	2,615,475.00	0.05
267	300811	铂科新材	36,000	2,567,160.00	0.05
268	301221	光庭信息	45,600	2,564,544.00	0.05
269	002988	豪美新材	69,200	2,546,560.00	0.05
270	600654	中安科	662,200	2,496,494.00	0.05
271	002796	世嘉科技	88,100	2,443,013.00	0.05
272	002931	锋龙股份	76,100	2,412,370.00	0.05
273	688123	聚辰股份	19,200	2,411,136.00	0.05
274	688601	力芯微	56,400	2,402,076.00	0.05
275	301209	联合化学	21,100	2,381,979.00	0.05
276	603373	安邦护卫	62,000	2,353,520.00	0.05
277	002552	宝鼎科技	141,800	2,341,118.00	0.05
278	603019	中科曙光	27,200	2,329,408.00	0.05
279	605277	新亚电子	104,800	2,305,600.00	0.05
280	000045	深纺织A	184,500	2,254,590.00	0.04
281	300866	安克创新	19,200	2,196,288.00	0.04
282	000050	深天马A	241,700	2,182,551.00	0.04
283	300476	胜宏科技	7,500	2,156,850.00	0.04
284	301538	骏鼎达	26,800	2,148,824.00	0.04
285	300409	道氏技术	95,100	2,138,799.00	0.04
286	002111	威海广泰	201,800	2,122,936.00	0.04
287	002134	天津普林	79,100	2,119,089.00	0.04
288	688072	拓荆科技	6,400	2,112,000.00	0.04
289	688347	华虹公司	19,545	2,108,319.15	0.04
290	300956	英力股份	126,089	2,098,120.96	0.04
291	601999	出版传媒	302,400	2,077,488.00	0.04
292	002334	英威腾	230,300	2,077,306.00	0.04
293	002695	煌上煌	176,500	2,072,110.00	0.04
294	002655	共达电声	159,600	2,062,032.00	0.04
295	301265	华新环保	147,120	2,046,439.20	0.04

296	300395	菲利华	20,400	2,046,120.00	0.04
297	000880	潍柴重机	74,844	2,044,738.08	0.04
298	300281	金明精机	250,100	2,043,317.00	0.04
299	002686	亿利达	306,900	2,007,126.00	0.04
300	688166	博瑞医药	40,600	1,991,836.00	0.04
301	603680	今创集团	127,950	1,971,709.50	0.04
302	300153	科泰电源	67,800	1,970,946.00	0.04
303	000811	冰轮环境	105,850	1,960,342.00	0.04
304	688063	派能科技	34,200	1,943,244.00	0.04
305	300433	蓝思科技	64,100	1,940,307.00	0.04
306	002773	康弘药业	64,700	1,939,059.00	0.04
307	300066	三川智慧	309,600	1,928,808.00	0.04
308	002993	奥海科技	43,960	1,921,491.60	0.04
309	002975	博杰股份	24,700	1,901,900.00	0.04
310	605196	华通线缆	54,300	1,886,382.00	0.04
311	301236	软通动力	39,200	1,859,256.00	0.04
312	688396	华润微	34,000	1,797,240.00	0.04
313	605376	博迁新材	27,100	1,772,340.00	0.03
314	300132	青松股份	200,600	1,747,226.00	0.03
315	301102	兆讯传媒	166,519	1,746,784.31	0.03
316	000001	平安银行	153,000	1,745,730.00	0.03
317	301270	汉仪股份	46,700	1,745,646.00	0.03
318	603328	依顿电子	158,100	1,732,776.00	0.03
319	688498	源杰科技	2,600	1,669,174.00	0.03
320	300791	仙乐健康	64,090	1,657,367.40	0.03
321	688802	沐曦股份	3,994	1,595,203.60	0.03
322	002097	山河智能	128,100	1,589,721.00	0.03
323	603786	科博达	19,600	1,530,760.00	0.03
324	601007	金陵饭店	194,600	1,519,826.00	0.03
325	603486	科沃斯	18,700	1,508,716.00	0.03
326	300898	熊猫乳品	53,800	1,448,834.00	0.03

327	002938	鹏鼎控股	28,301	1,431,464.58	0.03
328	300394	天孚通信	7,020	1,425,270.60	0.03
329	600577	精达股份	110,000	1,367,300.00	0.03
330	001389	广合科技	16,400	1,338,732.00	0.03
331	601211	国泰海通	65,000	1,335,750.00	0.03
332	002138	顺络电子	37,400	1,328,822.00	0.03
333	688665	四方光电	27,226	1,327,812.02	0.03
334	002284	亚太股份	88,600	1,322,798.00	0.03
335	300727	润禾材料	36,400	1,297,296.00	0.03
336	300644	南京聚隆	34,400	1,269,704.00	0.03
337	688591	泰凌微	29,676	1,263,010.56	0.02
338	002410	广联达	99,500	1,251,710.00	0.02
339	002706	良信股份	113,700	1,225,686.00	0.02
340	002664	信质集团	50,300	1,205,188.00	0.02
341	600104	上汽集团	79,000	1,202,380.00	0.02
342	600900	长江电力	44,100	1,199,079.00	0.02
343	300804	广康生化	33,731	1,180,585.00	0.02
344	300735	光弘科技	47,163	1,172,472.18	0.02
345	301021	英诺激光	23,600	1,148,140.00	0.02
346	300711	广哈通信	49,160	1,141,495.20	0.02
347	600930	华电新能	181,825	1,134,588.00	0.02
348	002371	北方华创	2,468	1,133,009.44	0.02
349	301212	联盛化学	37,400	1,120,504.00	0.02
350	002913	奥士康	26,200	1,119,788.00	0.02
351	688248	南网科技	24,942	1,115,905.08	0.02
352	600031	三一重工	52,300	1,105,099.00	0.02
353	300347	泰格医药	19,000	1,077,300.00	0.02
354	601633	长城汽车	47,459	1,073,997.17	0.02
355	601336	新华保险	15,200	1,059,440.00	0.02
356	600435	北方导航	66,000	1,017,720.00	0.02
357	688006	杭可科技	34,600	1,013,434.00	0.02

358	688795	摩尔线程	2,321	965,953.78	0.02
359	688108	赛诺医疗	49,400	950,456.00	0.02
360	003816	中国广核	251,900	947,144.00	0.02
361	300953	震裕科技	5,600	940,912.00	0.02
362	300226	上海钢联	37,448	940,693.76	0.02
363	301007	德迈仕	23,200	940,064.00	0.02
364	688629	华丰科技	9,200	920,552.00	0.02
365	002987	京北方	42,000	904,260.00	0.02
366	002128	电投能源	32,100	895,911.00	0.02
367	000568	泸州老窖	7,700	894,894.00	0.02
368	600873	梅花生物	83,900	849,907.00	0.02
369	300950	德固特	36,500	834,390.00	0.02
370	002648	卫星化学	47,100	832,728.00	0.02
371	300277	海联讯	63,100	823,455.00	0.02
372	300760	迈瑞医疗	4,300	818,935.00	0.02
373	301080	百普赛斯	14,900	804,600.00	0.02
374	601998	中信银行	101,500	781,550.00	0.02
375	600578	京能电力	153,000	780,300.00	0.02
376	002518	科士达	16,000	776,320.00	0.02
377	002649	博彦科技	58,485	771,417.15	0.02
378	002590	万安科技	50,600	759,000.00	0.01
379	603103	横店影视	45,500	754,390.00	0.01
380	002096	易普力	56,200	748,584.00	0.01
381	002389	航天彩虹	31,000	743,380.00	0.01
382	300553	集智股份	18,100	731,059.00	0.01
383	601068	中铝国际	135,400	716,266.00	0.01
384	603085	天成自控	60,200	713,370.00	0.01
385	688578	艾力斯	6,800	708,220.00	0.01
386	300739	明阳电路	38,488	707,409.44	0.01
387	000333	美的集团	9,000	703,350.00	0.01
388	002601	龙佰集团	35,500	695,090.00	0.01

389	688281	华秦科技	9,400	693,720.00	0.01
390	001872	招商港口	35,800	692,014.00	0.01
391	002790	瑞尔特	80,100	672,039.00	0.01
392	001338	永顺泰	54,300	657,573.00	0.01
393	002164	宁波东力	40,700	651,607.00	0.01
394	301077	星华新材	24,800	641,824.00	0.01
395	300771	智莱科技	40,900	633,950.00	0.01
396	002349	精华制药	86,400	627,264.00	0.01
397	600927	永安期货	38,700	621,909.00	0.01
398	603050	科林电气	33,900	610,878.00	0.01
399	688553	汇宇制药	33,800	601,302.00	0.01
400	000531	穗恒运 A	92,800	594,848.00	0.01
401	000738	航发控制	26,900	573,239.00	0.01
402	002955	鸿合科技	18,800	569,076.00	0.01
403	002156	通富微电	14,900	561,730.00	0.01
404	600415	小商品城	33,900	540,705.00	0.01
405	601919	中远海控	35,300	535,854.00	0.01
406	002182	宝武镁业	34,700	530,910.00	0.01
407	601728	中国电信	83,100	523,530.00	0.01
408	002709	天赐材料	11,200	518,896.00	0.01
409	603697	有友食品	41,600	509,600.00	0.01
410	601018	宁波港	137,600	499,488.00	0.01
411	300489	光智科技	9,500	482,600.00	0.01
412	001266	宏英智能	7,700	303,149.00	0.01
413	688783	西安奕材	14,790	271,544.40	0.01
414	301656	联合动力	7,395	188,276.70	0.00
415	688765	禾元生物	3,529	185,695.98	0.00
416	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.00
417	688729	屹唐股份	3,505	85,101.40	0.00
418	688759	必贝特	2,789	70,031.79	0.00
419	688790	昂瑞微	516	60,470.04	0.00

420	688809	强一股份	259	52,657.29	0.00
421	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
422	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
423	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
424	001233	海安集团	370	19,195.60	0.00
425	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
426	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
427	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
428	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
429	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
430	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
431	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
432	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
433	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
434	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
435	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
436	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
437	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
438	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
439	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
440	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
441	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
442	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
443	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
444	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
445	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
446	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
447	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
448	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
449	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
450	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00

451	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
452	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	259,264,289.54	15.84
2	601138	工业富联	229,912,451.00	14.05
3	300502	新易盛	201,922,877.89	12.34
4	300394	天孚通信	195,491,909.40	11.95
5	688256	寒武纪	192,664,734.61	11.77
6	300014	亿纬锂能	190,267,425.40	11.63
7	300033	同花顺	176,465,238.31	10.78
8	600183	生益科技	175,927,216.44	10.75
9	300308	中际旭创	175,886,897.03	10.75
10	688111	金山办公	174,206,840.66	10.65
11	688772	珠海冠宇	167,666,453.32	10.25
12	002916	深南电路	166,357,754.29	10.17
13	002475	立讯精密	162,313,244.00	9.92
14	300604	长川科技	160,692,461.70	9.82
15	603893	瑞芯微	159,947,721.80	9.77
16	300476	胜宏科技	157,232,896.76	9.61
17	300450	先导智能	150,956,131.82	9.22
18	002558	巨人网络	147,583,437.80	9.02
19	300274	阳光电源	144,779,272.20	8.85
20	000063	中兴通讯	136,753,896.03	8.36
21	300803	指南针	134,515,030.80	8.22
22	688981	中芯国际	132,929,082.01	8.12

23	300496	中科创达	131,452,659.73	8.03
24	300124	汇川技术	131,205,957.43	8.02
25	301316	慧博云通	130,634,293.26	7.98
26	603659	璞泰来	129,052,738.48	7.89
27	688270	臻镭科技	125,116,388.12	7.65
28	300319	麦捷科技	124,405,726.02	7.60
29	688313	仕佳光子	123,367,708.84	7.54
30	688041	海光信息	122,994,231.17	7.52
31	002415	海康威视	120,316,323.47	7.35
32	300939	秋田微	118,931,857.90	7.27
33	002222	福晶科技	118,428,007.31	7.24
34	688498	源杰科技	117,915,126.98	7.21
35	688385	复旦微电	117,601,946.38	7.19
36	300395	菲利华	116,131,436.00	7.10
37	605058	澳弘电子	114,626,088.26	7.00
38	688183	生益电子	110,900,310.73	6.78
39	000823	超声电子	110,600,723.00	6.76
40	300389	艾比森	110,399,932.07	6.75
41	300491	通合科技	109,681,153.50	6.70
42	300454	深信服	109,550,744.30	6.69
43	301185	鸥玛软件	109,419,656.28	6.69
44	000977	浪潮信息	107,876,140.40	6.59
45	002913	奥士康	107,161,435.60	6.55
46	301165	锐捷网络	106,668,873.00	6.52
47	002625	光启技术	106,082,040.00	6.48
48	688629	华丰科技	105,485,034.61	6.45
49	688008	澜起科技	105,481,061.41	6.45
50	002851	麦格米特	105,218,542.34	6.43
51	300866	安克创新	104,830,532.09	6.41
52	300602	飞荣达	102,778,344.10	6.28
53	603678	火炬电子	102,510,474.56	6.26

54	002265	建设工业	101,711,637.62	6.22
55	688322	奥比中光	100,958,418.35	6.17
56	300870	欧陆通	99,969,771.10	6.11
57	300739	明阳电路	99,857,428.33	6.10
58	300852	四会富仕	98,390,859.53	6.01
59	002080	中材科技	97,452,965.25	5.96
60	301095	广立微	96,451,101.23	5.89
61	002517	恺英网络	96,158,505.00	5.88
62	688362	甬矽电子	95,733,353.47	5.85
63	603259	药明康德	94,566,336.50	5.78
64	301018	申菱环境	94,328,609.88	5.76
65	300207	欣旺达	94,251,577.00	5.76
66	300570	太辰光	94,248,641.68	5.76
67	300428	立中集团	94,162,975.85	5.75
68	300219	鸿利智汇	93,987,911.00	5.74
69	300407	凯发电气	93,143,279.92	5.69
70	688025	杰普特	92,933,828.00	5.68
71	301413	安培龙	92,603,459.54	5.66
72	688475	萤石网络	92,073,915.61	5.63
73	301308	江波龙	91,956,628.86	5.62
74	600967	内蒙一机	91,867,766.95	5.61
75	301391	卡莱特	91,253,868.64	5.58
76	301106	骏成科技	90,886,710.44	5.55
77	002074	国轩高科	89,286,215.40	5.46
78	603859	能科科技	89,059,781.64	5.44
79	603486	科沃斯	88,984,523.50	5.44
80	688372	伟测科技	88,618,732.57	5.42
81	000725	京东方 A	88,478,505.00	5.41
82	301226	祥明智能	87,834,674.80	5.37
83	688049	炬芯科技	87,467,769.45	5.35
84	600372	中航机载	85,175,789.72	5.21

85	300548	长芯博创	84,692,514.89	5.18
86	603236	移远通信	84,391,054.50	5.16
87	688668	鼎通科技	84,034,900.69	5.14
88	603296	华勤技术	83,916,865.20	5.13
89	002576	通达动力	83,615,673.60	5.11
90	300806	斯迪克	83,214,271.52	5.09
91	300909	汇创达	82,980,122.87	5.07
92	002396	星网锐捷	82,959,660.00	5.07
93	603920	世运电路	82,739,508.80	5.06
94	002049	紫光国微	82,560,152.00	5.05
95	600941	中国移动	82,425,540.90	5.04
96	002179	中航光电	82,422,948.22	5.04
97	300790	宇瞳光学	81,944,928.00	5.01
98	002600	领益智造	81,746,366.00	5.00
99	603444	吉比特	81,582,109.00	4.99
100	601988	中国银行	79,548,486.00	4.86
101	003816	中国广核	79,364,828.00	4.85
102	600309	万华化学	79,118,437.90	4.83
103	300872	天阳科技	79,077,045.40	4.83
104	601857	中国石油	78,483,752.00	4.80
105	300925	法本信息	78,349,601.50	4.79
106	002384	东山精密	77,700,907.00	4.75
107	301102	兆讯传媒	77,168,197.53	4.72
108	002138	顺络电子	77,046,817.12	4.71
109	300320	海达股份	77,001,604.46	4.71
110	002273	水晶光电	76,867,976.24	4.70
111	688143	长盈通	76,473,635.94	4.67
112	300136	信维通信	76,443,577.45	4.67
113	688208	道通科技	75,856,044.83	4.64
114	301153	中科江南	75,757,173.60	4.63
115	688222	成都先导	75,638,811.32	4.62

116	688778	厦钨新能	74,973,772.53	4.58
117	002410	广联达	74,961,895.57	4.58
118	300984	金沃股份	74,781,644.36	4.57
119	603267	鸿远电子	74,729,412.44	4.57
120	002993	奥海科技	74,496,185.20	4.55
121	600498	烽火通信	74,443,828.09	4.55
122	688182	灿勤科技	73,606,133.78	4.50
123	002938	鹏鼎控股	73,374,173.79	4.48
124	300251	光线传媒	73,189,878.00	4.47
125	688689	银河微电	73,056,889.00	4.46
126	301042	安联锐视	72,942,717.00	4.46
127	300170	汉得信息	72,851,815.00	4.45
128	688018	乐鑫科技	72,657,737.69	4.44
129	300763	锦浪科技	72,456,781.82	4.43
130	300378	鼎捷数智	72,021,893.26	4.40
131	600938	中国海油	71,940,305.00	4.40
132	300105	龙源技术	70,970,465.00	4.34
133	603979	金诚信	70,755,840.62	4.32
134	301338	凯格精机	70,753,219.00	4.32
135	000657	中钨高新	70,719,164.48	4.32
136	002593	日上集团	70,066,944.27	4.28
137	300787	海能实业	69,999,440.76	4.28
138	002796	世嘉科技	69,505,572.73	4.25
139	300760	迈瑞医疗	69,471,822.44	4.25
140	603993	洛阳钼业	69,404,655.00	4.24
141	301489	思泉新材	69,328,930.48	4.24
142	603380	易德龙	69,272,353.00	4.23
143	688612	威迈斯	68,609,112.01	4.19
144	301099	雅创电子	68,529,413.38	4.19
145	300017	网宿科技	68,499,292.64	4.19
146	688591	泰凌微	68,371,686.98	4.18

147	002782	可立克	68,222,465.40	4.17
148	301217	铜冠铜箔	68,086,346.00	4.16
149	301221	光庭信息	67,918,472.00	4.15
150	300850	新强联	66,985,731.83	4.09
151	300951	博硕科技	66,516,715.43	4.06
152	688138	清溢光电	66,287,400.01	4.05
153	002955	鸿合科技	65,901,315.20	4.03
154	603966	法兰泰克	65,114,547.29	3.98
155	688589	力合微	64,973,948.98	3.97
156	601633	长城汽车	64,908,190.95	3.97
157	000811	冰轮环境	64,893,283.88	3.97
158	301626	苏州天脉	64,664,297.00	3.95
159	300442	润泽科技	64,087,933.00	3.92
160	300735	光弘科技	64,022,496.88	3.91
161	301606	绿联科技	63,956,267.31	3.91
162	601877	正泰电器	63,321,916.70	3.87
163	688610	埃科光电	62,438,629.38	3.82
164	301195	北路智控	62,431,003.77	3.82
165	600276	恒瑞医药	61,973,471.63	3.79
166	300777	中简科技	61,870,223.00	3.78
167	688392	骄成超声	61,511,142.95	3.76
168	002649	博彦科技	61,325,641.95	3.75
169	300620	光库科技	61,183,992.12	3.74
170	688657	浩辰软件	61,140,970.77	3.74
171	300857	协创数据	60,168,295.33	3.68
172	688390	固德威	60,008,451.23	3.67
173	601899	紫金矿业	59,493,778.00	3.64
174	600885	宏发股份	59,255,012.28	3.62
175	688472	阿特斯	58,925,313.63	3.60
176	002335	科华数据	58,398,525.28	3.57
177	601869	长飞光纤	58,349,663.00	3.57

178	603590	康辰药业	57,823,256.00	3.53
179	601668	中国建筑	57,397,612.80	3.51
180	300113	顺网科技	57,390,893.00	3.51
181	300102	乾照光电	57,204,254.00	3.50
182	605099	共创草坪	56,950,503.07	3.48
183	603799	华友钴业	56,267,708.00	3.44
184	600570	恒生电子	55,808,320.08	3.41
185	000426	兴业银锡	55,745,614.00	3.41
186	600050	中国联通	55,643,043.00	3.40
187	300771	智莱科技	55,580,912.80	3.40
188	601336	新华保险	55,521,639.00	3.39
189	300515	三德科技	55,223,345.52	3.37
190	688618	三旺通信	55,119,567.60	3.37
191	300550	和仁科技	55,092,382.57	3.37
192	001301	尚太科技	55,028,772.32	3.36
193	000738	航发控制	54,938,486.00	3.36
194	002755	奥赛康	54,451,064.80	3.33
195	300292	吴通控股	54,291,508.99	3.32
196	600363	联创光电	53,801,896.16	3.29
197	601088	中国神华	53,756,086.00	3.28
198	688371	菲沃泰	53,746,773.90	3.28
199	000938	紫光股份	53,633,701.60	3.28
200	600406	国电南瑞	53,632,514.00	3.28
201	603341	龙旗科技	53,553,208.34	3.27
202	688002	睿创微纳	53,464,491.91	3.27
203	002733	雄韬股份	53,389,310.81	3.26
204	601728	中国电信	53,349,360.00	3.26
205	002484	江海股份	53,218,424.00	3.25
206	301107	瑜欣电子	53,120,626.60	3.25
207	601995	中金公司	53,066,246.00	3.24
208	603228	景旺电子	52,965,991.28	3.24

209	002578	闽发铝业	52,952,354.00	3.24
210	001359	平安电工	52,923,126.08	3.23
211	601727	上海电气	52,866,858.00	3.23
212	300532	今天国际	52,798,531.28	3.23
213	002402	和而泰	52,666,664.86	3.22
214	000858	五粮液	52,503,549.14	3.21
215	688676	金盘科技	52,342,162.78	3.20
216	601628	中国人寿	52,335,096.00	3.20
217	688292	浩瀚深度	52,191,518.89	3.19
218	301358	湖南裕能	52,168,101.00	3.19
219	002976	瑞玛精密	52,157,361.00	3.19
220	002602	世纪华通	51,856,436.00	3.17
221	605123	派克新材	51,757,177.20	3.16
222	600028	中国石化	51,564,919.00	3.15
223	002414	高德红外	51,424,666.00	3.14
224	688088	虹软科技	51,239,481.05	3.13
225	688286	敏芯股份	51,207,760.66	3.13
226	300991	创益通	51,117,797.40	3.12
227	301389	隆扬电子	51,048,742.15	3.12
228	002463	沪电股份	51,023,477.00	3.12
229	000333	美的集团	50,929,979.00	3.11
230	300088	长信科技	50,719,611.00	3.10
231	688590	新致软件	50,456,498.29	3.08
232	003007	直真科技	50,102,537.10	3.06
233	002885	京泉华	50,055,197.20	3.06
234	301031	中熔电气	50,039,543.59	3.06
235	600582	天地科技	49,959,765.00	3.05
236	002922	伊戈尔	49,860,338.10	3.05
237	000651	格力电器	49,703,483.00	3.04
238	002987	京北方	49,681,035.20	3.04
239	600011	华能国际	49,580,959.00	3.03

240	605186	健麾信息	49,534,659.65	3.03
241	600490	鹏欣资源	49,402,308.48	3.02
242	300813	泰林生物	49,093,788.20	3.00
243	300990	同飞股份	49,044,354.68	3.00
244	300976	达瑞电子	49,028,501.68	3.00
245	688661	和林微纳	49,022,573.48	3.00
246	300708	聚灿光电	48,846,954.40	2.98
247	300465	高伟达	48,718,344.00	2.98
248	301419	阿莱德	48,577,617.80	2.97
249	300015	爱尔眼科	48,534,286.00	2.97
250	600089	特变电工	48,522,403.70	2.97
251	301589	诺瓦星云	48,422,795.48	2.96
252	603986	兆易创新	48,273,593.86	2.95
253	000733	振华科技	48,251,067.00	2.95
254	002230	科大讯飞	48,152,191.00	2.94
255	002876	三利谱	48,088,445.00	2.94
256	688787	海天瑞声	48,035,598.72	2.94
257	300445	康斯特	48,029,321.20	2.94
258	002027	分众传媒	47,710,308.00	2.92
259	300458	全志科技	47,675,025.43	2.91
260	002935	天奥电子	47,335,035.52	2.89
261	603103	横店影视	47,313,811.00	2.89
262	301511	德福科技	47,189,315.67	2.88
263	688288	鸿泉技术	46,851,932.05	2.86
264	300054	鼎龙股份	46,846,543.00	2.86
265	601872	招商轮船	46,798,156.00	2.86
266	300176	鸿特科技	46,740,864.00	2.86
267	300932	三友联众	46,667,104.44	2.85
268	300232	洲明科技	46,600,745.00	2.85
269	000988	华工科技	46,551,175.97	2.84
270	301278	快可电子	46,484,993.60	2.84

271	002869	金溢科技	46,349,482.00	2.83
272	600057	厦门象屿	46,275,324.54	2.83
273	301269	华大九天	45,572,240.48	2.78
274	300456	赛微电子	45,500,880.00	2.78
275	688036	传音控股	45,483,964.84	2.78
276	300805	电声股份	45,370,583.84	2.77
277	300921	南凌科技	45,347,722.60	2.77
278	301377	鼎泰高科	45,339,936.28	2.77
279	002404	嘉欣丝绸	45,135,037.00	2.76
280	301538	骏鼎达	45,124,657.69	2.76
281	300493	润欣科技	44,882,109.06	2.74
282	300115	长盈精密	44,741,527.65	2.73
283	301086	鸿富瀚	44,674,928.70	2.73
284	300468	四方精创	44,656,181.00	2.73
285	300559	佳发教育	44,642,579.86	2.73
286	001229	魅视科技	44,551,614.00	2.72
287	002768	国恩股份	44,540,923.72	2.72
288	000156	华数传媒	44,398,646.00	2.71
289	603191	望变电气	44,249,318.00	2.70
290	600662	外服控股	44,028,165.00	2.69
291	300543	朗科智能	43,942,556.38	2.69
292	603160	汇顶科技	43,850,913.47	2.68
293	603206	嘉环科技	43,825,076.45	2.68
294	000039	中集集团	43,464,603.24	2.66
295	300789	唐源电气	43,269,280.10	2.64
296	301270	汉仪股份	43,199,575.80	2.64
297	002322	理工能科	43,006,110.00	2.63
298	601126	四方股份	43,004,930.98	2.63
299	600879	航天电子	42,707,875.36	2.61
300	688579	地纬智能	42,523,534.88	2.60
301	000045	深纺织 A	42,318,787.00	2.59

302	605066	天正电气	42,253,564.75	2.58
303	300286	安科瑞	41,961,232.85	2.56
304	000600	建投能源	41,915,596.84	2.56
305	600415	小商品城	41,761,336.00	2.55
306	688768	容知日新	41,718,254.12	2.55
307	301171	易点天下	41,430,149.70	2.53
308	301536	星宸科技	41,020,588.80	2.51
309	300726	宏达电子	41,016,598.48	2.51
310	688593	新相微	40,939,265.68	2.50
311	600654	中安科	40,777,781.00	2.49
312	603256	宏和科技	40,725,162.00	2.49
313	603038	华立股份	40,690,612.00	2.49
314	301205	联特科技	40,595,463.20	2.48
315	301080	百普赛斯	40,559,744.30	2.48
316	300690	双一科技	40,524,404.00	2.48
317	688127	蓝特光学	40,523,816.29	2.48
318	301132	满坤科技	40,320,816.00	2.46
319	601319	中国人保	40,318,914.00	2.46
320	300709	精研科技	40,283,252.00	2.46
321	600019	宝钢股份	40,224,435.00	2.46
322	600386	北巴传媒	40,103,756.80	2.45
323	002201	九鼎新材	40,024,826.00	2.45
324	002901	大博医疗	39,996,733.96	2.44
325	688519	南亚新材	39,980,404.19	2.44
326	600487	亨通光电	39,942,595.00	2.44
327	301330	熵基科技	39,881,686.64	2.44
328	688258	卓易信息	39,825,493.77	2.43
329	002134	天津普林	39,778,934.00	2.43
330	002315	焦点科技	39,733,767.00	2.43
331	301318	维海德	39,727,191.90	2.43
332	603737	三棵树	39,501,089.60	2.41

333	300131	英唐智控	39,347,652.00	2.40
334	300048	合康新能	39,346,252.00	2.40
335	300711	广哈通信	39,221,624.69	2.40
336	300101	振芯科技	39,178,625.15	2.39
337	688120	华海清科	39,126,170.92	2.39
338	300154	瑞凌股份	39,042,114.00	2.39
339	603989	艾华集团	39,034,387.90	2.39
340	002983	芯瑞达	39,027,507.39	2.38
341	603786	科博达	38,983,515.00	2.38
342	002977	天箭科技	38,970,313.08	2.38
343	002236	大华股份	38,955,064.00	2.38
344	301267	华夏眼科	38,948,831.00	2.38
345	600114	东睦股份	38,886,248.98	2.38
346	600704	物产中大	38,809,220.00	2.37
347	002345	潮宏基	38,638,438.00	2.36
348	300341	麦克奥迪	38,589,083.00	2.36
349	601999	出版传媒	38,444,151.00	2.35
350	002358	森源电气	38,309,555.00	2.34
351	000932	华菱钢铁	38,180,260.01	2.33
352	300413	芒果超媒	38,163,848.00	2.33
353	603218	日月股份	38,109,211.00	2.33
354	600826	兰生股份	38,097,734.96	2.33
355	300972	万辰集团	37,969,092.00	2.32
356	605020	永和股份	37,871,356.52	2.31
357	301209	联合化学	37,832,887.45	2.31
358	600025	华能水电	37,818,168.00	2.31
359	300512	中亚股份	37,737,681.50	2.31
360	002050	三花智控	37,690,261.11	2.30
361	000810	创维数字	37,666,777.00	2.30
362	301282	金禄电子	37,568,331.80	2.30
363	600685	中船防务	37,535,505.54	2.29

364	688153	唯捷创芯	37,469,778.72	2.29
365	300475	香农芯创	37,227,564.00	2.27
366	300964	本川智能	36,837,820.00	2.25
367	600850	电科数字	36,835,643.10	2.25
368	002952	亚世光电	36,659,491.00	2.24
369	301299	卓创资讯	36,441,479.00	2.23
370	000783	长江证券	36,396,019.68	2.22
371	688319	欧林生物	36,264,766.68	2.22
372	301157	华塑科技	36,258,924.74	2.22
373	300452	山河药辅	36,209,369.50	2.21
374	300987	川网传媒	35,871,766.00	2.19
375	688551	科威尔	35,818,234.49	2.19
376	688391	钜泉科技	35,638,093.03	2.18
377	600873	梅花生物	35,523,632.00	2.17
378	002824	和胜股份	35,403,943.70	2.16
379	002107	沃华医药	35,395,632.00	2.16
380	603999	读者传媒	35,356,693.00	2.16
381	001216	华瓷股份	35,340,908.08	2.16
382	002706	良信股份	35,241,724.00	2.15
383	002140	东华科技	34,902,520.80	2.13
384	002811	郑中设计	34,857,874.50	2.13
385	605288	凯迪股份	34,763,847.10	2.12
386	688280	精进电动	34,431,094.92	2.10
387	301011	华立科技	34,356,848.00	2.10
388	002787	华源控股	34,316,528.93	2.10
389	300687	赛意信息	34,279,168.06	2.09
390	002090	金智科技	34,258,612.00	2.09
391	300693	盛弘股份	34,224,019.00	2.09
392	301387	光大同创	34,203,947.00	2.09
393	300590	移为通信	34,096,843.00	2.08
394	002281	光迅科技	34,065,396.63	2.08

395	000709	河钢股份	34,051,540.40	2.08
396	002352	顺丰控股	33,913,987.00	2.07
397	002714	牧原股份	33,912,816.80	2.07
398	002779	中坚科技	33,907,442.30	2.07
399	300230	永利股份	33,805,544.00	2.07
400	300672	国科微	33,774,557.00	2.06
401	002160	常铝股份	33,731,160.00	2.06
402	600690	海尔智家	33,726,290.00	2.06
403	300373	扬杰科技	33,649,408.00	2.06
404	301059	金三江	33,634,978.00	2.06
405	002815	崇达技术	33,498,681.37	2.05
406	600219	南山铝业	33,495,897.00	2.05
407	000768	中航西飞	33,404,960.00	2.04
408	688012	中微公司	33,348,183.32	2.04
409	603289	泰瑞机器	33,310,940.00	2.04
410	600549	厦门钨业	33,307,646.54	2.04
411	301388	欣灵电气	33,229,927.00	2.03
412	301121	紫建电子	33,017,024.00	2.02
413	002837	英维克	32,854,914.25	2.01
414	688588	凌志软件	32,796,381.32	2.00

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601138	工业富联	234,053,265.52	14.30
2	600183	生益科技	202,301,172.89	12.36
3	300750	宁德时代	197,930,570.60	12.10

4	300394	天孚通信	192,139,239.44	11.74
5	300476	胜宏科技	192,094,949.88	11.74
6	688256	寒武纪	178,423,241.01	10.90
7	688111	金山办公	161,966,480.71	9.90
8	603893	瑞芯微	155,988,535.14	9.53
9	300604	长川科技	154,244,772.84	9.43
10	300450	先导智能	153,577,467.13	9.38
11	300014	亿纬锂能	153,159,816.57	9.36
12	000063	中兴通讯	153,089,773.90	9.36
13	300033	同花顺	153,084,146.90	9.35
14	300502	新易盛	152,278,457.48	9.31
15	300803	指南针	151,312,915.75	9.25
16	300274	阳光电源	151,303,555.20	9.25
17	002916	深南电路	150,325,934.67	9.19
18	002558	巨人网络	147,341,539.69	9.00
19	688772	珠海冠宇	144,916,420.38	8.86
20	300308	中际旭创	143,247,305.22	8.75
21	688270	臻镭科技	142,059,271.26	8.68
22	688981	中芯国际	136,524,001.06	8.34
23	688313	仕佳光子	133,944,240.43	8.19
24	688041	海光信息	131,871,769.53	8.06
25	002913	奥士康	124,270,928.40	7.59
26	688498	源杰科技	122,532,777.39	7.49
27	300395	菲利华	122,071,732.00	7.46
28	300319	麦捷科技	119,883,918.96	7.33
29	603659	璞泰来	117,638,049.64	7.19
30	300454	深信服	116,737,406.88	7.13
31	002415	海康威视	115,115,288.36	7.03
32	300866	安克创新	110,339,157.92	6.74
33	301185	鸥玛软件	109,645,510.00	6.70
34	300870	欧陆通	109,058,163.79	6.66

35	301165	锐捷网络	108,928,476.10	6.66
36	300124	汇川技术	108,046,930.78	6.60
37	688183	生益电子	105,449,828.51	6.44
38	300739	明阳电路	104,152,714.06	6.36
39	688385	复旦微电	103,661,337.76	6.33
40	300207	欣旺达	100,864,011.58	6.16
41	688629	华丰科技	100,548,345.54	6.14
42	300496	中科创达	100,290,679.88	6.13
43	002080	中材科技	98,061,152.37	5.99
44	300570	太辰光	96,123,600.51	5.87
45	605058	澳弘电子	96,083,794.31	5.87
46	301106	骏成科技	94,170,559.80	5.75
47	002938	鹏鼎控股	93,992,728.00	5.74
48	301413	安培龙	93,920,903.16	5.74
49	603859	能科科技	93,399,820.12	5.71
50	300219	鸿利智汇	93,387,677.95	5.71
51	301018	申菱环境	93,230,839.13	5.70
52	300939	秋田微	91,295,530.22	5.58
53	600941	中国移动	91,039,988.20	5.56
54	002576	通达动力	90,898,808.07	5.55
55	002179	中航光电	90,726,756.32	5.54
56	301316	慧博云通	90,450,050.54	5.53
57	300852	四会富仕	89,644,087.69	5.48
58	688475	萤石网络	88,139,745.95	5.39
59	300389	艾比森	87,845,015.81	5.37
60	300548	长芯博创	87,735,593.66	5.36
61	000977	浪潮信息	87,468,309.00	5.35
62	300407	凯发电气	87,308,593.00	5.34
63	002222	福晶科技	87,299,530.48	5.33
64	688362	甬矽电子	87,207,046.28	5.33
65	002384	东山精密	87,109,027.00	5.32

66	300909	汇创达	87,034,552.24	5.32
67	301042	安联锐视	86,752,248.14	5.30
68	688372	伟测科技	86,522,590.77	5.29
69	688668	鼎通科技	85,856,074.85	5.25
70	000725	京东方 A	85,790,779.99	5.24
71	301226	祥明智能	85,412,980.00	5.22
72	000823	超声电子	85,020,490.22	5.20
73	002265	建设工业	84,841,284.64	5.18
74	301308	江波龙	84,450,985.84	5.16
75	301099	雅创电子	84,430,318.44	5.16
76	002475	立讯精密	84,196,182.98	5.15
77	601857	中国石油	82,978,303.04	5.07
78	002138	顺络电子	82,580,649.08	5.05
79	603444	吉比特	82,467,638.00	5.04
80	603296	华勤技术	82,257,558.12	5.03
81	603380	易德龙	81,885,109.00	5.00
82	300763	锦浪科技	80,720,686.64	4.93
83	603486	科沃斯	80,332,721.71	4.91
84	003816	中国广核	79,309,336.00	4.85
85	688208	道通科技	79,033,043.19	4.83
86	688018	乐鑫科技	78,857,708.63	4.82
87	300787	海能实业	78,021,459.50	4.77
88	002049	紫光国微	77,799,875.00	4.75
89	688143	长盈通	77,628,851.76	4.74
90	688222	成都先导	77,460,421.72	4.73
91	600938	中国海油	76,579,342.00	4.68
92	300790	宇瞳光学	76,529,172.50	4.68
93	301489	思泉新材	76,525,233.96	4.68
94	688322	奥比中光	76,466,557.94	4.67
95	002851	麦格米特	76,204,883.88	4.66
96	002593	日上集团	76,201,974.47	4.66

97	603799	华友钴业	76,016,924.21	4.65
98	002396	星网锐捷	75,688,081.00	4.63
99	600372	中航机载	75,531,424.74	4.62
100	002782	可立克	74,817,674.00	4.57
101	300925	法本信息	74,448,728.50	4.55
102	002410	广联达	74,361,937.00	4.54
103	601988	中国银行	74,175,412.00	4.53
104	688025	杰普特	74,087,668.45	4.53
105	301338	凯格精机	73,673,001.00	4.50
106	301153	中科江南	73,103,260.20	4.47
107	300602	飞荣达	72,576,159.83	4.44
108	301102	兆讯传媒	72,557,735.26	4.43
109	600498	烽火通信	72,428,451.02	4.43
110	002993	奥海科技	72,380,065.40	4.42
111	300170	汉得信息	72,148,825.20	4.41
112	688689	银河微电	71,216,161.65	4.35
113	688049	炬芯科技	71,053,854.13	4.34
114	300491	通合科技	70,648,510.60	4.32
115	300428	立中集团	70,608,081.29	4.31
116	300320	海达股份	70,175,632.39	4.29
117	300251	光线传媒	69,221,171.00	4.23
118	688392	骄成超声	69,172,669.13	4.23
119	603678	火炬电子	69,154,213.25	4.23
120	600309	万华化学	68,265,489.00	4.17
121	603267	鸿远电子	68,132,341.58	4.16
122	300872	天阳科技	67,698,280.58	4.14
123	600406	国电南瑞	67,300,150.24	4.11
124	300017	网宿科技	67,007,342.00	4.09
125	688589	力合微	66,945,296.75	4.09
126	300806	斯迪克	66,849,697.72	4.09
127	002796	世嘉科技	66,763,014.00	4.08

128	000811	冰轮环境	66,755,716.68	4.08
129	300857	协创数据	66,085,621.07	4.04
130	300951	博硕科技	65,669,407.71	4.01
131	300760	迈瑞医疗	65,519,734.26	4.00
132	688591	泰凌微	65,403,035.76	4.00
133	002578	闽发铝业	65,246,342.90	3.99
134	300105	龙源技术	65,215,913.00	3.99
135	002733	雄韬股份	64,474,007.58	3.94
136	688657	浩辰软件	64,468,187.40	3.94
137	002955	鸿合科技	64,432,669.30	3.94
138	688472	阿特斯	64,391,215.21	3.93
139	300777	中简科技	64,367,155.07	3.93
140	301221	光庭信息	64,245,426.69	3.93
141	688778	厦钨新能	64,186,206.38	3.92
142	300620	光库科技	63,650,333.00	3.89
143	002987	京北方	63,540,047.52	3.88
144	300378	鼎捷数智	63,441,002.39	3.88
145	300850	新强联	62,976,609.13	3.85
146	002649	博彦科技	62,881,740.00	3.84
147	300735	光弘科技	62,788,836.30	3.84
148	002625	光启技术	62,043,615.00	3.79
149	300442	润泽科技	61,814,958.00	3.78
150	301095	广立微	61,678,684.00	3.77
151	601336	新华保险	61,499,975.27	3.76
152	301195	北路智控	61,464,998.19	3.76
153	600967	内蒙一机	61,297,366.70	3.75
154	600885	宏发股份	61,134,431.04	3.74
155	300515	三德科技	60,857,830.04	3.72
156	601633	长城汽车	60,604,704.26	3.70
157	300102	乾照光电	60,496,984.52	3.70
158	603259	药明康德	60,095,322.80	3.67

159	688676	金盘科技	59,895,380.14	3.66
160	301391	卡莱特	59,564,033.40	3.64
161	603986	兆易创新	58,453,770.00	3.57
162	002335	科华数据	58,344,598.59	3.57
163	301389	隆扬电子	58,321,646.37	3.56
164	300771	智莱科技	58,198,357.89	3.56
165	300136	信维通信	57,902,527.01	3.54
166	600050	中国联通	57,611,904.00	3.52
167	688610	埃科光电	57,311,730.07	3.50
168	600363	联创光电	57,131,767.04	3.49
169	002885	京泉华	56,947,649.20	3.48
170	601668	中国建筑	56,571,924.40	3.46
171	001301	尚太科技	56,402,061.98	3.45
172	603966	法兰泰克	56,380,314.74	3.45
173	300990	同飞股份	56,131,779.60	3.43
174	000938	紫光股份	55,894,765.80	3.42
175	603236	移远通信	55,881,768.30	3.41
176	300976	达瑞电子	55,863,760.28	3.41
177	301217	铜冠铜箔	55,696,372.00	3.40
178	000858	五粮液	55,395,867.06	3.39
179	301358	湖南裕能	55,232,814.00	3.38
180	300232	洲明科技	55,079,763.00	3.37
181	000333	美的集团	55,074,706.33	3.37
182	601727	上海电气	55,065,330.00	3.36
183	301107	瑜欣电子	54,984,699.44	3.36
184	600089	特变电工	54,900,377.35	3.35
185	002027	分众传媒	54,739,131.16	3.35
186	000156	华数传媒	54,715,048.00	3.34
187	300984	金沃股份	54,419,831.40	3.33
188	002922	伊戈尔	54,200,581.25	3.31
189	603228	景旺电子	53,985,776.00	3.30

190	688787	海天瑞声	53,963,706.78	3.30
191	688008	澜起科技	53,904,812.20	3.29
192	003007	直真科技	53,657,540.06	3.28
193	688612	威迈斯	53,589,799.07	3.27
194	002484	江海股份	53,585,808.00	3.27
195	688579	地纬智能	53,386,551.66	3.26
196	601728	中国电信	52,691,044.00	3.22
197	601628	中国人寿	52,675,587.00	3.22
198	002201	九鼎新材	52,669,539.07	3.22
199	300113	顺网科技	52,595,653.00	3.21
200	300292	吴通控股	52,579,182.33	3.21
201	688590	新致软件	52,482,115.53	3.21
202	300456	赛微电子	52,369,776.46	3.20
203	301330	熵基科技	52,349,853.33	3.20
204	601877	正泰电器	52,297,679.50	3.20
205	000738	航发控制	52,272,458.03	3.19
206	601995	中金公司	51,666,831.84	3.16
207	000988	华工科技	51,563,650.00	3.15
208	300532	今天国际	51,458,050.23	3.14
209	002517	恺英网络	51,356,016.00	3.14
210	002230	科大讯飞	51,138,911.00	3.13
211	002236	大华股份	51,092,288.94	3.12
212	300054	鼎龙股份	50,959,484.25	3.11
213	002755	奥赛康	50,773,605.40	3.10
214	002935	天奥电子	50,712,802.11	3.10
215	600879	航天电子	50,710,425.54	3.10
216	002977	火箭科技	50,585,256.95	3.09
217	301419	阿莱德	50,339,113.78	3.08
218	600011	华能国际	50,009,456.00	3.06
219	600582	天地科技	49,965,432.00	3.05
220	000426	兴业银锡	49,912,859.06	3.05

221	301377	鼎泰高科	49,896,081.49	3.05
222	001229	魅视科技	49,849,350.50	3.05
223	300088	长信科技	49,848,079.00	3.05
224	603920	世运电路	49,797,498.30	3.04
225	300445	康斯特	49,638,013.80	3.03
226	300458	全志科技	49,575,620.57	3.03
227	600057	厦门象屿	49,099,242.70	3.00
228	605123	派克新材	49,077,075.00	3.00
229	300543	朗科智能	48,969,726.12	2.99
230	688292	浩瀚深度	48,914,488.79	2.99
231	300465	高伟达	48,888,607.00	2.99
232	603979	金诚信	48,755,209.00	2.98
233	000651	格力电器	48,720,781.00	2.98
234	300708	聚灿光电	48,618,112.25	2.97
235	600490	鹏欣资源	48,503,334.63	2.96
236	688036	传音控股	48,414,057.49	2.96
237	605066	天正电气	48,406,413.99	2.96
238	601088	中国神华	47,970,175.00	2.93
239	300805	电声股份	47,718,861.44	2.92
240	688371	菲沃泰	47,676,257.63	2.91
241	002107	沃华医药	47,495,295.80	2.90
242	688258	卓易信息	47,400,391.92	2.90
243	603989	艾华集团	47,387,509.00	2.90
244	600028	中国石化	47,372,576.00	2.89
245	301278	快可电子	47,358,290.73	2.89
246	601999	出版传媒	47,333,088.03	2.89
247	002876	三利谱	46,932,555.72	2.87
248	603993	洛阳钼业	46,920,843.00	2.87
249	605186	健麾信息	46,918,820.42	2.87
250	603103	横店影视	46,906,497.60	2.87
251	300015	爱尔眼科	46,796,113.54	2.86

252	688286	敏芯股份	46,726,939.33	2.86
253	601126	四方股份	46,697,454.00	2.85
254	002050	三花智控	46,362,702.36	2.83
255	301086	鸿富瀚	46,346,868.00	2.83
256	002352	顺丰控股	46,255,072.48	2.83
257	688618	三旺通信	46,243,007.33	2.83
258	301269	华大九天	46,177,311.36	2.82
259	688120	华海清科	45,861,419.08	2.80
260	002463	沪电股份	45,571,341.21	2.78
261	688088	虹软科技	45,494,761.30	2.78
262	601899	紫金矿业	45,482,751.00	2.78
263	300493	润欣科技	45,420,057.89	2.78
264	301270	汉仪股份	45,384,599.73	2.77
265	300176	鸿特科技	45,231,428.36	2.76
266	301538	骏鼎达	45,199,577.66	2.76
267	002768	国恩股份	45,117,718.03	2.76
268	002869	金溢科技	45,074,128.50	2.75
269	603191	望变电气	45,069,699.69	2.75
270	600025	华能水电	45,010,922.00	2.75
271	002976	瑞玛精密	43,978,688.84	2.69
272	300115	长盈精密	43,918,072.59	2.68
273	000600	建投能源	43,803,988.64	2.68
274	300286	安科瑞	43,685,688.00	2.67
275	300726	宏达电子	43,683,063.00	2.67
276	300991	创益通	43,596,160.82	2.66
277	300468	四方精创	43,547,313.00	2.66
278	300690	双一科技	43,418,204.50	2.65
279	600276	恒瑞医药	43,369,258.69	2.65
280	002600	领益智造	43,246,896.00	2.64
281	002594	比亚迪	43,220,480.00	2.64
282	603038	华立股份	43,214,516.60	2.64

283	000039	中集集团	42,989,913.44	2.63
284	300964	本川智能	42,906,209.40	2.62
285	301589	诺瓦星云	42,801,376.40	2.62
286	603160	汇顶科技	42,764,952.15	2.61
287	300789	唐源电气	42,621,689.75	2.60
288	600662	外服控股	42,530,378.00	2.60
289	002134	天津普林	42,388,355.00	2.59
290	601319	中国人保	42,127,006.00	2.57
291	000045	深纺织 A	42,104,934.00	2.57
292	002322	理工能科	42,033,125.84	2.57
293	001359	平安电工	42,013,410.38	2.57
294	301282	金禄电子	41,948,562.80	2.56
295	002273	水晶光电	41,786,325.72	2.55
296	002315	焦点科技	41,759,600.00	2.55
297	002983	芯瑞达	41,652,787.24	2.55
298	300341	麦克奥迪	41,581,911.00	2.54
299	300131	英唐智控	41,568,595.77	2.54
300	002074	国轩高科	41,549,447.50	2.54
301	002266	浙富控股	41,466,539.15	2.53
302	603206	嘉环科技	41,355,229.96	2.53
303	300101	振芯科技	41,285,082.41	2.52
304	300475	香农芯创	41,245,115.40	2.52
305	301031	中熔电气	40,888,035.04	2.50
306	603341	龙旗科技	40,730,436.00	2.49
307	301171	易点天下	40,727,235.04	2.49
308	688002	睿创微纳	40,715,415.24	2.49
309	600386	北巴传媒	40,641,312.70	2.48
310	600704	物产中大	40,511,154.10	2.48
311	000657	中钨高新	40,323,389.64	2.46
312	301080	百普赛斯	40,171,771.76	2.45
313	600654	中安科	40,061,563.28	2.45

314	688685	迈信林	39,827,062.63	2.43
315	688768	容知日新	39,807,670.18	2.43
316	000932	华菱钢铁	39,501,964.42	2.41
317	603218	日月股份	39,442,618.00	2.41
318	688593	新相微	39,221,291.15	2.40
319	301626	苏州天脉	39,198,584.62	2.40
320	605020	永和股份	39,180,004.29	2.39
321	603737	三棵树	38,977,127.00	2.38
322	002358	森源电气	38,427,806.00	2.35
323	002952	亚世光电	38,310,623.00	2.34
324	301205	联特科技	38,147,762.00	2.33
325	688661	和林微纳	37,956,420.48	2.32
326	301132	满坤科技	37,950,362.52	2.32
327	603786	科博达	37,948,735.46	2.32
328	600685	中船防务	37,906,147.07	2.32
329	600873	梅花生物	37,901,020.40	2.32
330	688138	清溢光电	37,885,289.57	2.32
331	688182	灿勤科技	37,751,900.97	2.31
332	301387	光大同创	37,741,526.00	2.31
333	600900	长江电力	37,708,757.00	2.30
334	301318	维海德	37,703,575.11	2.30
335	688588	凌志软件	37,419,784.84	2.29
336	002714	牧原股份	37,404,910.00	2.29
337	300987	川网传媒	37,295,771.55	2.28
338	300768	迪普科技	37,226,737.78	2.27
339	002140	东华科技	37,220,983.87	2.27
340	600415	小商品城	37,219,874.00	2.27
341	300693	盛弘股份	37,080,551.00	2.27
342	301511	德福科技	37,061,593.80	2.26
343	300373	扬杰科技	37,037,230.00	2.26
344	300512	中亚股份	36,993,507.90	2.26

345	301267	华夏眼科	36,948,912.14	2.26
346	301299	卓创资讯	36,944,036.29	2.26
347	002787	华源控股	36,940,967.50	2.26
348	601218	吉鑫科技	36,827,307.00	2.25
349	300972	万辰集团	36,649,591.00	2.24
350	605288	凯迪股份	36,431,442.78	2.23
351	002202	金风科技	36,382,700.36	2.22
352	300711	广哈通信	35,912,806.29	2.19
353	600219	南山铝业	35,852,942.00	2.19
354	688319	欧林生物	35,774,154.07	2.19
355	688391	钜泉科技	35,664,200.69	2.18
356	300559	佳发教育	35,664,051.00	2.18
357	688127	蓝特光学	35,444,976.77	2.17
358	300048	合康新能	35,131,808.00	2.15
359	300672	国科微	35,119,290.08	2.15
360	688195	腾景科技	34,891,865.36	2.13
361	300743	天地数码	34,872,360.64	2.13
362	300618	寒锐钴业	34,864,477.72	2.13
363	002706	良信股份	34,861,594.00	2.13
364	300590	移为通信	34,860,231.10	2.13
365	300222	科大智能	34,819,989.00	2.13
366	001216	华瓷股份	34,671,795.26	2.12
367	600690	海尔智家	34,644,487.00	2.12
368	000768	中航西飞	34,548,321.76	2.11
369	688403	汇成股份	34,518,867.72	2.11
370	601919	中远海控	34,481,806.50	2.11
371	688012	中微公司	34,417,523.16	2.10
372	603289	泰瑞机器	34,402,364.20	2.10
373	300230	永利股份	34,324,208.68	2.10
374	002090	金智科技	34,153,604.00	2.09
375	000709	河钢股份	33,945,350.20	2.07

376	002779	中坚科技	33,834,722.00	2.07
377	002160	常铝股份	33,823,854.00	2.07
378	603588	高能环境	33,773,120.00	2.06
379	300150	世纪瑞尔	33,601,648.00	2.05
380	002815	崇达技术	33,551,573.69	2.05
381	688582	芯动联科	33,472,957.90	2.05
382	000682	东方电子	33,443,591.93	2.04
383	001283	豪鹏科技	33,307,471.08	2.04
384	301059	金三江	33,069,803.40	2.02
385	300681	英搏尔	33,043,379.36	2.02
386	301396	宏景科技	33,030,451.21	2.02
387	300443	金雷股份	32,994,711.44	2.02
388	688522	纳睿雷达	32,965,125.34	2.01
389	688095	福昕软件	32,930,818.97	2.01
390	600114	东睦股份	32,922,101.14	2.01
391	300634	彩讯股份	32,861,861.11	2.01

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	41,989,806,073.90
卖出股票收入（成交）总额	40,181,155,207.08

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	264,004,359.02	5.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,354,112.77	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	265,358,471.79	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	019773	25国债08	1,655,000	167,170,960.56	3.29
2	019785	25国债13	858,000	86,317,385.75	1.70
3	019766	25国债01	104,000	10,516,012.71	0.21
4	111024	澳弘转债	13,540	1,354,112.77	0.03

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

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	38,487,412.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,487,412.79

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

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
博道成长智航股票A	58,526	27,708.89	300,672,163.92	18.54%	1,321,018,375.67	81.46%
博道成长智航股票C	13,145	13,893.75	907,689,711.29	49.70%	918,740,931.08	50.30%
合计	18,261	18,882.23	1,208,361,875.21	35.04%	2,239,759,306.75	64.96%

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	博道成长智航股票A	2,139,553.34	0.13%
	博道成长智航股票C	13,812.13	0.00%
	合计	2,153,365.47	0.06%

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	博道成长智航股票A	>100
	博道成长智航股票C	0~10

	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	博道成长智航股票A	0~10
	博道成长智航股票C	0
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	博道成长智航股票A	博道成长智航股票C
基金合同生效日(2021年10月26日)基金份额总额	1,621,392,996.40	1,171,980,429.74
本报告期期初基金份额总额	821,807,418.39	839,438,037.03
本报告期基金总申购份额	2,601,984,512.95	3,185,668,448.26
减：本报告期基金总赎回份额	1,802,101,391.75	2,198,675,842.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,621,690,539.59	1,826,430,642.37

注：

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

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：报告期内，经董事会审议通过，聘任邵东先生担任公司首席信息官，张丽女士不再兼任公司首席信息官，继续担任公司首席运营官。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。

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容诚会计师事务所(特殊普通合伙),本期审计费用请见"7.4.7.17 其他费用"。容诚会计师事务所(特殊普通合伙)自2024年12月19日起为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	2	12,528,990,860.91	15.25%	5,464,756.55	14.80%	-
广发证券	2	54,465,805,664.47	66.29%	24,835,053.12	67.28%	-

国泰海通证券	2	15,168,944,828.90	18.46%	6,612,697.96	17.91%	-
--------	---	-------------------	--------	--------------	--------	---

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
方正证券	89,940,409.42	23.02%	279,770,000.00	49.41%	-	-	-	-
广发证券	245,251,548.02	62.77%	286,409,000.00	50.59%	-	-	-	-
国泰海通证券	55,517,158.44	14.21%	4,000.00	0.00%	-	-	-	-

注：

1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；国泰君安证券股份有限公司于2025年3月14日完成吸收合并海通证券股份有限公司，并自2025年4月3日起更名为国泰海通证券股份有限公司。

2、基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，财务状况良好；
- (2) 具备良好的合规风控能力，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 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；
- (4) 具有较强的全方位金融服务及研究能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面。

3、基金交易单元的选择程序如下：

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

4、报告期内，本基金已严格遵守证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

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、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	2025-01-16
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	2025-01-22
3	博道成长智航股票型证券投资基金2024年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-22
4	博道基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	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	2025-03-08
5	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	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	2025-03-14
6	博道基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
7	博道基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2025-03-31
8	博道成长智航股票型证券投资基金2024年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
9	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海万得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	2025-04-07
10	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	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	2025-04-11
11	博道基金管理有限公司旗下	中国证券报、上海证券报、	2025-04-22

	部分基金季度报告提示性公告	证券时报、证券日报	
12	博道成长智航股票型证券投资基金2025年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-04-22
13	博道基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	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	2025-05-15
14	博道基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-06
15	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	2025-07-21
16	博道成长智航股票型证券投资基金2025年第二季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-07-21
17	博道基金管理有限公司旗下部分基金中期报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2025-08-29
18	博道成长智航股票型证券投资基金2025年中期报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-08-29
19	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金开通同一基金不同类别基金份额相互转换业务的公告	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	2025-09-01
20	博道成长智航股票型证券投资基金（更新）招募说明书（2025年第1号）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-09-26
21	博道成长智航股票型证券投资基金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	2025-09-26
22	博道基金管理有限公司旗下	中国证券报、上海证券报、	2025-10-28

	部分基金季度报告提示性公告	证券时报、证券日报	
23	博道成长智航股票型证券投资基金2025年第三季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-10-28
24	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人及其关联方承销证券的公告	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	2025-11-27
25	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	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	2025-12-18

§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成长智航股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道成长智航股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道成长智航股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道成长智航股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道成长智航股票型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内博道成长智航股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站（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
二〇二六年三月三十一日