

博道消费智航股票型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	63
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	63
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	63
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 盈利投资者数量占比	65

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	65
§9 开放式基金份额变动	66
§10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	67
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	67
10.8 其他重大事件	68
§11 备查文件目录	70
11.1 备查文件目录	70
11.2 存放地点	70
11.3 查阅方式	70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道消费智航股票型证券投资基金	
基金简称	博道消费智航	
基金主代码	010998	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年05月07日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	660,046,372.80份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道消费智航A	博道消费智航C
下属分级基金的交易代码	010998	018695
报告期末下属分级基金的份额总额	184,657,623.03份	475,388,749.77份

注：根据2023年6月17日发布的《博道基金管理有限公司关于博道消费智航股票型证券投资基金增设C类基金份额并修订相关法律文件的公告》，本基金自2023年6月20日起增设C类基金份额，原有基金份额全部自动转为A类基金份额。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注消费主题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，业绩比较基准中股票资产部分以中信消费风格指数为基准指数，通过量化选股模型构建股票组合，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。本基金重点投资于中信消费风格指数涵盖的消费制造和消费服务业及与其密切相关上下游产业的上市公司，主要包括：食品饮料、医药、农林牧渔、家电、商贸零售、纺织服装、轻工制造、消费者服务、房地产、传媒等行业。对于当前未被归入前述行业，但后续因为科学技术发展、产业结构升级、并购重组、业务转型等原因，提供的产品或服务隶属于上述行业

	的公司，本基金也可将其纳入消费主题范畴。个股选择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，综合评价后挑选符合一定标准的股票构建组合，其中投资于本基金界定的消费主题股票的比例不低于非现金基金资产的80%。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、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中信消费风格指数收益率×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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛	王茵
	联系电话	021-80226288	010-63639180
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		400-085-2888	95595
传真		021-80226289	010-63639132
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		200122	100033
法定代表人		莫泰山	吴利军

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日-2026年06月30日)	
	博道消费智航A	博道消费智航C
本期已实现收益	-2,159,269.42	-10,125,921.26
本期利润	-6,305,835.27	-36,120,699.33
加权平均基金份额本期利润	-0.0321	-0.0715
本期加权平均净值利润率	-3.41%	-7.73%
本期基金份额净值增长率	-6.06%	-6.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	-23,623,077.84	-67,226,406.40
期末可供分配基金份额利润	-0.1279	-0.1414
期末基金资产净值	161,034,545.19	408,162,343.37
期末基金份额净值	0.8721	0.8586
3.1.3 累计期末指标	报告期末	

	(2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-12.79%	5.44%

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

博道消费智航A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-5.29%	0.86%	-9.63%	0.83%	4.34%	0.03%
过去六个月	-6.06%	1.02%	-12.04%	0.94%	5.98%	0.08%
过去一年	4.44%	0.87%	-7.74%	0.80%	12.18%	0.07%
过去三年	6.37%	1.14%	-12.37%	1.06%	18.74%	0.08%
过去五年	-14.99%	1.15%	-30.55%	1.10%	15.56%	0.05%
自基金合同 生效起至今	-12.79%	1.14%	-27.40%	1.09%	14.61%	0.05%

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。

博道消费智航C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-5.41%	0.86%	-9.63%	0.83%	4.22%	0.03%
过去六个月	-6.30%	1.02%	-12.04%	0.94%	5.74%	0.08%
过去一年	3.95%	0.87%	-7.74%	0.80%	11.69%	0.07%
过去三年	4.73%	1.14%	-12.37%	1.06%	17.10%	0.08%

自基金合同生效起至今	5.44%	1.14%	-13.39%	1.06%	18.83%	0.08%
------------	-------	-------	---------	-------	--------	-------

注：1、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；
2、本基金自2023年6月20日起增设C类基金份额，该类份额首次确认日为2023年6月21日，增设当年的相关数据和指标按实际存续期计算。

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：1、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；

2、本基金自2023年6月20日起增设C类基金份额，该类份额首次确认日为2023年6月21日，增设当年的相关数据和指标按实际存续期计算。

§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。公司具备公开募集证券投资基金管理、私募资产管理等业务资格。公司管理的首只公募基金于2018年8月10日成立。截至报告期末，公司旗下管理的公募基金涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金等多种类型。

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		

刘玮明	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合、博道久航混合、博道红利智航股票、博道大盘成长股票、博道大盘价值股票、博道衍和债券、博道衍晟混合、博道和裕多元稳健30天持有期债券、博道和祥多元稳健债券的基金经理	2024-04-27	2026-04-29	7年	刘玮明先生，中国籍，金融硕士。2019年6月加入博道基金管理有限公司，历任量化投资部专户投资经理兼任高级量化研究员。具有基金从业资格。
刘兆阳	博道叁佰智航、博道伍佰智航、博道消费智航、博道红利智航股票、博道启航混合、博道沪深300指数量化增强、博道中证800指数增强的基金经理、量化投资部总经理助理	2025-11-11	-	4年	刘兆阳先生，中国籍，金融硕士。2022年7月加入博道基金管理有限公司，历任量化投资部量化研究员、高级量化研究员。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守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，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，为基金份额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，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，本公司管理的所有投资组合参与交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况共发生4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

2026年上半年，受美以伊冲突、油价波动和流动性预期变化影响，全球市场剧烈震荡，风险偏好先抑后扬。A股主要宽基指数多数上涨，但结构分化明显，上证指数上涨3.16%，沪深300上涨7.55%，中证500上涨20.97%，中证1000上涨15.99%。风格上，中信成长风格指数上涨36.71%，中信周期风格指数下跌4.31%，中信消费风格指数下跌13.46%，中信金融风格指数下跌12.58%，中信稳定风格指数下跌6.36%。行业层面，电子、通信、建材涨幅居前，分别上涨85.49%、74.54%、43.70%，消费者服务、综合金融、综合跌幅较大，分别下跌31.88%、29.59%、25.09%。

从因子层面来看，表征景气度的基本面因子表现较好，价值类因子创下历史最大回撤，AI量价因子表现差异较大，部分因子策略捕捉到了较强的动量效应，部分因子策略偏量价反转逻辑。极致的抱团风格下，量化策略的环境并不友好。研究层面，博道量化团队继续围绕双均衡框架进行升级，以及推动组合优化与风控模块持续迭代。

报告期间，本基金维持配置中信消费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

展望未来，主要宽基指数的预期盈利增速仍处于抬升阶段，预计市场重心将继续围绕基本面和产业趋势展开；对于量化产品而言，需重点关注三四季度动量反转的可能性并做好防范应对。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在博道消费智航股票型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面的运作严格依据基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司以自身能够获取的数据和信息为限，根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对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进行了复核，认为以上内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博道消费智航股票型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	32,246,157.67	22,180,611.58
结算备付金		3,548.75	3,524.51
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	556,766,544.91	598,469,135.16
其中：股票投资		527,375,514.48	567,243,303.46
基金投资		-	-
债券投资		29,391,030.43	31,225,831.70
资产支持证券 投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		258,727.50	189,774.72
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		589,274,978.83	620,843,045.97
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		19,113,259.54	2,343,170.59
应付管理人报酬		596,895.57	538,828.94
应付托管费		99,482.60	89,804.80
应付销售服务费		180,890.75	111,398.77
应付投资顾问费		-	-
应交税费		954.44	210.23
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	86,607.37	177,866.01
负债合计		20,078,090.27	3,261,279.34
净资产:			
实收基金	6.4.7.6	660,046,372.80	670,228,049.72
未分配利润	6.4.7.7	-90,849,484.24	-52,646,283.09
净资产合计		569,196,888.56	617,581,766.63
负债和净资产总计		589,274,978.83	620,843,045.97

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

6.2 利润表

会计主体：博道消费智航股票型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		-36,632,651.34	26,445,182.35
1.利息收入		6,195.28	8,492.47
其中：存款利息收入	6.4.7.8	6,194.95	8,492.17
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		0.33	0.30
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-6,660,755.19	26,563,850.85
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-14,942,011.05	22,471,500.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	222,879.42	105,196.18
资产支持证券投资 收益	6.4.7.11	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	8,058,376.44	3,987,154.34
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.14	-30,141,343.92	-177,182.99

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	163,252.49	50,022.02
减：二、营业总支出		5,793,883.26	2,080,317.59
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	3,894,851.28	1,678,301.21
2.托管费	6.4.10.2.2	649,141.84	279,716.87
3.销售服务费		1,160,495.16	31,041.17
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		13,407.44	17,753.09
其中：卖出回购金融资产支出		13,407.44	17,753.09
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		490.72	0.12
8.其他费用	6.4.7.16	75,496.82	73,505.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-42,426,534.60	24,364,864.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-42,426,534.60	24,364,864.76
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-42,426,534.60	24,364,864.76

6.3 净资产变动表

会计主体：博道消费智航股票型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资	670,228,049.72	-52,646,283.09	617,581,766.63

产			
二、本期期初净资产	670,228,049.72	-52,646,283.09	617,581,766.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,181,676.92	-38,203,201.15	-48,384,878.07
（一）、综合收益总额	-	-42,426,534.60	-42,426,534.60
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-10,181,676.92	4,223,333.45	-5,958,343.47
其中：1.基金申购款	420,833,335.16	-25,439,348.01	395,393,987.15
2.基金赎回款	-431,015,012.08	29,662,681.46	-401,352,330.62
（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	660,046,372.80	-90,849,484.24	569,196,888.56
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	368,780,746.55	-86,241,326.94	282,539,419.61
二、本期期初净资产	368,780,746.55	-86,241,326.94	282,539,419.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-25,389,592.11	29,402,349.58	4,012,757.47

（一）、综合收益总额	-	24,364,864.76	24,364,864.76
（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）	-25,389,592.11	5,037,484.82	-20,352,107.29
其中：1.基金申购款	26,650,922.83	-5,515,805.85	21,135,116.98
2.基金赎回款	-52,040,514.94	10,553,290.67	-41,487,224.27
（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	343,391,154.44	-56,838,977.36	286,552,177.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

莫泰山

张丽

严娅

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博道消费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[2020]2964号《关于准予博道消费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《博道消费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590,299,610.06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0468号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道消费智航股票型证券投资基金基金合同》于2021年5月7日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为

590,493,121.54份基金份额，其中认购资金利息折合193,511.48份基金份额。本基金的管理人为博道基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《博道基金管理有限公司关于博道消费智航股票型证券投资基金增设C类基金份额并修订相关法律文件的公告》，自2023年6月20日起，本基金在现有基金份额的基础上增设C类基金份额，原有基金份额全部自动转为A类基金份额。根据更新后的《博道消费智航股票型证券投资基金基金合同》和《博道消费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。在投资人申购基金时收取申购费用，并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资人申购基金时不收取申购费用，而是从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。相关费率的设置及费率水平在招募说明书或相关公告中列示。本基金两类基金份额分别设置代码，分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道消费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。基金管理人在进行融资融券等投资前，须与基金托管人就交收结算、核算估值等业务规则和流程进行沟通确定，在系统测试通过后才可投资，否则，由此产生的风险由基金管理人承担。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%，投资于本基金界定的消费主题股票的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为中信消费风格指数收益率 $\times 90\%$ +同期银行活期存款利率(税后) $\times 10\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规

定(以下合称"企业会计准则")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的《公开募集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》《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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2026年01月01日至2026年06月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2026年06月30日的财务状况以及2026年01月01日至2026年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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。2027年12月31日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。
- 2027年12月31日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	1,150,670.39
等于：本金	1,150,549.70
加：应计利息	120.69
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	31,095,487.28
等于：本金	31,095,235.40
加：应计利息	251.88
减：坏账准备	-
合计	32,246,157.67

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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		567,604,317.91	-	527,375,514.48	-40,228,803.43
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	29,150,773.94	230,293.13	29,391,030.43	9,963.36
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	29,150,773.94	230,293.13	29,391,030.43	9,963.36
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		596,755,091.85	230,293.13	556,766,544.91	-40,218,840.07

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。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	394.76
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	14,876.39
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	11,828.85
合计	86,607.37

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 博道消费智航A

金额单位：人民币元

项目 (博道消费智航A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	285,520,987.79	285,520,987.79
本期申购	38,092,223.66	38,092,223.66

本期赎回（以“-”号填列）	-138,955,588.42	-138,955,588.42
本期末	184,657,623.03	184,657,623.03

6.4.7.6.2 博道消费智航C

金额单位：人民币元

项目 (博道消费智航C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	384,707,061.93	384,707,061.93
本期申购	382,741,111.50	382,741,111.50
本期赎回（以“-”号填列）	-292,059,423.66	-292,059,423.66
本期末	475,388,749.77	475,388,749.77

注：

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

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 博道消费智航A

单位：人民币元

项目 (博道消费智航A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-19,117,968.49	-1,326,378.06	-20,444,346.55
本期期初	-19,117,968.49	-1,326,378.06	-20,444,346.55
本期利润	-2,159,269.42	-4,146,565.85	-6,305,835.27
本期基金份额交易产生的变动数	6,147,936.10	-3,020,832.12	3,127,103.98
其中：基金申购款	-1,788,812.08	-91,945.18	-1,880,757.26
基金赎回款	7,936,748.18	-2,928,886.94	5,007,861.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,129,301.81	-8,493,776.03	-23,623,077.84

6.4.7.7.2 博道消费智航C

单位：人民币元

项目 (博道消费智航C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-30,471,709.54	-1,730,227.00	-32,201,936.54
本期期初	-30,471,709.54	-1,730,227.00	-32,201,936.54
本期利润	-10,125,921.26	-25,994,778.07	-36,120,699.33
本期基金份额交易产生的变动数	-5,132,476.03	6,228,705.50	1,096,229.47
其中：基金申购款	-24,705,110.85	1,146,520.10	-23,558,590.75
基金赎回款	19,572,634.82	5,082,185.40	24,654,820.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-45,730,106.83	-21,496,299.57	-67,226,406.40

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	2,612.25
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,558.46
结算备付金利息收入	24.24
其他	-
合计	6,194.95

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	3,240,510,204.36
减：卖出股票成本总额	3,250,592,248.07
减：交易费用	4,859,967.34
买卖股票差价收入	-14,942,011.05

6.4.7.10 债券投资收益**6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	218,253.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,625.73
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	222,879.42

6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	26,549,973.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	26,264,455.13
减：应计利息总额	280,876.43
减：交易费用	16.07
买卖债券差价收入	4,625.73

6.4.7.11 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	8,058,376.44
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,058,376.44

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-30,141,343.92
——股票投资	-30,142,963.35
——债券投资	1,619.43
——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	-30,141,343.92

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	124,673.37
转换费收入	38,579.12

合计	163,252.49
----	------------

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。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	1,113.06
合计	75,496.82

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博道基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,894,851.28	1,678,301.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	890,776.89	569,779.31
应支付基金管理人的净管理费	3,004,074.39	1,108,521.90

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026	上年度可比期间 2025年01月01日至2025
----	------------------------	-----------------------------

	年06月30日	年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	649,141.84	279,716.87

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道消费智航A	博道消费智航C	合计
博道基金管理有限公司	-	574,883.02	574,883.02
合计	-	574,883.02	574,883.02
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道消费智航A	博道消费智航C	合计
博道基金管理有限公司	-	9,596.23	9,596.23
合计	-	9,596.23	9,596.23

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

博道消费智航A

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	5,216,845.24	5,216,845.24
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	-	-
报告期末持有的基金份额	5,216,845.24	5,216,845.24
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.83%	1.61%

博道消费智航C

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	1,229,478.08	1,229,478.08
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	1,229,478.08	1,229,478.08
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.26%	6.30%

注：

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；
- 3、如果本报告期间发生认购、申购、转换入、红利再投、赎回、转换出等业务，本基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	1,150,670.39	2,612.25	1,389,908.65	5,934.01

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688802	沐曦股份	2025-12-09	9个月	科创板打新限	104.66	768.89	1,198	125,382.68	921,130.22	-

				售						
301666	大普微	2026-04-08	6个月	创业板打新限售	46.08	463.33	1,046	48,199.68	484,643.18	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	科创板打新限售	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9个月	科创板打新限售	22.68	42.16	5,951	134,968.68	250,894.16	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6个月	主板打新限售	10.11	10.11	20,880	211,096.80	211,096.80	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	科创板打新限售	19.68	141.49	1,042	20,506.56	147,432.58	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	科创板打新限售	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月	创业板打新限售	69.66	160.06	607	42,283.62	97,156.42	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6个月	科创板打新限售	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
001399	惠科	2026-06-1	6个月	主板	10.12	27.73	3,478	35,197.36	96,444.94	-

	股份	6		打新限售						
001248	华润新能源	2026-06-24	1个月内(含)	新股未上市	10.11	10.11	8,948	90,464.28	90,464.28	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	科创板打新限售	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	科创板打新限售	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	科创板打新限售	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	科创板打新限售	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月	主板打新限售	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	主板打新限售	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026-05-11	6个月	主板打新限售	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	科创板打新限售	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-

				售						
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月	创业板打新限售	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6个月	主板打新限售	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特电子	2026-06-02	6个月	创业板打新限售	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025-12-24	6个月	创业板打新限售	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
001393	维通利	2026-05-08	6个月	主板打新限售	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
301531	春光集团	2026-04-28	6个月	创业板打新限售	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6个月	创业板打新限售	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301680	固德电材	2026-02-27	6个月	创业板打新限售	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月	创业板打	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-

				新限售						
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	主板打新限售	11.18	17.59	604	6,752.72	10,624.36	-
688816	易思维	2026-02-04	6个月	科创板打新限售	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	主板打新限售	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6个月	创业板打新限售	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	主板打新限售	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月	主板打新限售	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	主板打新限售	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月	主板打新限售	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月	主板打新限售	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6个月	主板打新	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

				限售						
--	--	--	--	----	--	--	--	--	--	--

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的解限日和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国光大银行，其他存款存放于东方证券股份有限公司和浙商证券股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；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2026年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2025年12月31日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于2026年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2026年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.57%。

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2026年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为566,903,563.23元，超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							

货币资金	32,246,157.67	-	-	-	-	-	32,246,157.67
结算备付金	3,548.75	-	-	-	-	-	3,548.75
交易性金融资产	3,442,926.63	-	25,948,103.80	-	-	527,375,514.48	556,766,544.91
应收申购款	-	-	-	-	-	258,727.50	258,727.50
资产总计	35,692,633.05	-	25,948,103.80	-	-	527,634,241.98	589,274,978.83
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	19,113,259.54	19,113,259.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	596,895.57	596,895.57
应付托管费	-	-	-	-	-	99,482.60	99,482.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	180,890.75	180,890.75
应交税费	-	-	-	-	-	954.44	954.44
其他负债	-	-	-	-	-	86,607.37	86,607.37
负债总计	-	-	-	-	-	20,078,090.27	20,078,090.27
利率敏感度缺口	35,692,633.05	-	25,948,103.80	-	-	507,556,151.71	569,196,888.56
上年度末 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	22,180,611.58	-	-	-	-	-	22,180,611.58
结算备付金	3,524.51	-	-	-	-	-	3,524.51
交易性	-	-	31,225,831.70	-	-	567,243,303.46	598,469,135.16

金融资产							
应收申购款	-	-	-	-	-	189,774.72	189,774.72
资产总计	22,184,136.09	-	31,225,831.70	-	-	567,433,078.18	620,843,045.97
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,343,170.59	2,343,170.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	538,828.94	538,828.94
应付托管费	-	-	-	-	-	89,804.80	89,804.80
应付销售服务费	-	-	-	-	-	111,398.77	111,398.77
应交税费	-	-	-	-	-	210.23	210.23
其他负债	-	-	-	-	-	177,866.01	177,866.01
负债总计	-	-	-	-	-	3,261,279.34	3,261,279.34
利率敏感度缺口	22,184,136.09	-	31,225,831.70	-	-	564,171,798.84	617,581,766.63

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2026年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为5.16%(2025年12月31日：5.06%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2025年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产不低于基金资产的80%，投资于本基金界定的消费主题股票的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，本基金保留现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025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	527,375,514.48	92.65	567,243,303.46	91.85
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	527,375,514.48	92.65	567,243,303.46	91.85

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中信消费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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	1.中信消费风格指数收益率 上升5%	28,083,018.72	32,284,455.31
	2.中信消费风格指数收益率 下降5%	-28,083,018.72	-32,284,455.31

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	524,118,127.05	565,630,590.06
第二层次	29,692,591.51	31,225,831.70
第三层次	2,955,826.35	1,612,713.40
合计	556,766,544.91	598,469,135.16

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	527,375,514.48	89.50
	其中：股票	527,375,514.48	89.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,391,030.43	4.99
	其中：债券	29,391,030.43	4.99
	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	32,249,706.42	5.47
8	其他各项资产	258,727.50	0.04
9	合计	589,274,978.83	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	14,694,979.94	2.58
B	采矿业	599,723.82	0.11
C	制造业	449,335,916.48	78.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	301,561.08	0.05
E	建筑业	386,106.00	0.07
F	批发和零售业	18,915,438.22	3.32
G	交通运输、仓储和邮政业	65,210.46	0.01
H	住宿和餐饮业	356,720.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,639,607.00	0.64
J	金融业	2,136,790.00	0.38
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,556,609.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	28,450,632.88	5.00
N	水利、环境和公共设施管理业	2,277,120.00	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,489,971.60	0.44
R	文化、体育和娱乐业	169,128.00	0.03
S	综合	-	-

	合计	527,375,514.48	92.65
--	----	----------------	-------

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	44,004	52,166,301.96	9.16
2	000333	美的集团	432,490	32,665,969.70	5.74
3	603259	药明康德	194,537	24,221,801.87	4.26
4	300760	迈瑞医疗	98,382	13,363,227.06	2.35
5	600887	伊利股份	452,900	10,851,484.00	1.91
6	000651	格力电器	274,983	10,311,862.50	1.81
7	600809	山西汾酒	84,440	9,235,202.80	1.62
8	000858	五 粮 液	119,500	8,843,000.00	1.55
9	000895	双汇发展	290,700	6,511,680.00	1.14
10	688266	泽璟制药	55,000	6,416,300.00	1.13
11	002969	嘉美包装	426,800	6,009,344.00	1.06
12	002050	三花智控	135,020	5,917,926.60	1.04
13	002432	九安医疗	83,200	5,880,576.00	1.03
14	002676	顺威股份	1,174,800	5,850,504.00	1.03
15	603739	蔚蓝生物	492,300	5,676,219.00	1.00
16	003020	立方制药	372,580	5,517,909.80	0.97
17	688358	祥生医疗	179,988	5,502,233.16	0.97
18	002714	牧原股份	155,300	5,433,947.00	0.95
19	600251	冠农股份	624,200	5,393,088.00	0.95
20	300254	仟源医药	666,400	5,337,864.00	0.94
21	300342	天银机电	109,900	5,165,300.00	0.91

22	301093	华兰股份	37,900	5,140,377.00	0.90
23	688301	奕瑞科技	41,400	5,133,600.00	0.90
24	603696	安记食品	445,100	5,118,650.00	0.90
25	300049	福瑞医科	130,400	5,069,952.00	0.89
26	300279	和晶科技	832,700	5,037,835.00	0.89
27	688677	海泰新光	49,000	4,955,370.00	0.87
28	601579	会稽山	332,200	4,880,018.00	0.86
29	002429	兆驰股份	455,000	4,727,450.00	0.83
30	001313	粤海饲料	642,000	4,551,780.00	0.80
31	002458	益生股份	562,710	4,372,256.70	0.77
32	301122	采纳股份	148,000	4,352,680.00	0.76
33	605179	一鸣食品	343,600	4,319,052.00	0.76
34	688235	百济神州	16,396	4,174,585.56	0.73
35	300308	中际旭创	3,200	4,064,000.00	0.71
36	600690	海尔智家	199,020	4,061,998.20	0.71
37	688656	浩欧博	41,174	3,984,407.98	0.70
38	002788	鹭燕医药	396,900	3,980,907.00	0.70
39	002001	新 和 成	131,272	3,730,750.24	0.66
40	003018	金富科技	48,900	3,727,647.00	0.65
41	603309	维力医疗	314,000	3,523,080.00	0.62
42	300791	仙乐健康	214,930	3,443,178.60	0.60
43	300703	创源股份	267,100	3,410,867.00	0.60
44	300908	仲景食品	154,712	3,409,852.48	0.60
45	688221	前沿生物	150,800	3,377,920.00	0.59
46	300942	易瑞生物	573,900	3,317,142.00	0.58
47	300584	海辰药业	87,500	3,170,125.00	0.56
48	301087	可孚医疗	65,300	3,111,545.00	0.55
49	002397	梦洁股份	787,800	3,009,396.00	0.53
50	002228	合兴包装	1,019,800	2,998,212.00	0.53
51	300239	东宝生物	541,000	2,883,530.00	0.51
52	688799	华纳药厂	64,000	2,871,680.00	0.50

53	002695	煌上煌	282,078	2,863,091.70	0.50
54	688353	华盛锂电	22,800	2,646,396.00	0.46
55	300109	新开源	163,840	2,629,632.00	0.46
56	603336	宏辉果蔬	331,400	2,624,688.00	0.46
57	300016	北陆药业	325,600	2,497,352.00	0.44
58	300970	华绿生物	134,633	2,461,091.24	0.43
59	605499	东鹏饮料	19,930	2,459,959.90	0.43
60	605365	立达信	170,700	2,454,666.00	0.43
61	002294	信立泰	76,900	2,452,341.00	0.43
62	300138	晨光生物	264,400	2,379,600.00	0.42
63	300401	花园生物	106,300	2,326,907.00	0.41
64	000596	古井贡酒	28,800	2,298,240.00	0.40
65	603588	高能环境	118,600	2,277,120.00	0.40
66	002851	麦格米特	12,800	2,139,904.00	0.38
67	301367	瑞迈特	53,158	2,055,088.28	0.36
68	603685	晨丰科技	70,400	2,006,400.00	0.35
69	002345	潮宏基	216,000	1,980,720.00	0.35
70	300898	熊猫乳品	106,500	1,929,780.00	0.34
71	000534	万泽股份	70,000	1,915,200.00	0.34
72	000657	中钨高新	19,500	1,866,540.00	0.33
73	603057	紫燕食品	82,200	1,833,060.00	0.32
74	301377	鼎泰高科	3,300	1,817,970.00	0.32
75	002515	金字火腿	180,400	1,805,804.00	0.32
76	301060	兰卫医学	220,364	1,800,373.88	0.32
77	600710	苏美达	185,100	1,769,556.00	0.31
78	300199	翰宇药业	79,900	1,764,192.00	0.31
79	002582	好想你	207,900	1,756,755.00	0.31
80	002080	中材科技	19,200	1,728,000.00	0.30
81	600790	轻纺城	524,500	1,715,115.00	0.30
82	002242	九阳股份	214,800	1,688,328.00	0.30
83	688108	赛诺医疗	90,302	1,673,296.06	0.29

84	000776	广发证券	70,600	1,652,040.00	0.29
85	603156	养元饮品	33,600	1,648,752.00	0.29
86	000419	通程控股	361,600	1,630,816.00	0.29
87	002020	京新药业	127,500	1,592,475.00	0.28
88	002716	湖南白银	192,500	1,557,325.00	0.27
89	301230	泓博医药	42,000	1,547,280.00	0.27
90	300945	曼卡龙	132,898	1,439,285.34	0.25
91	300916	朗特智能	61,200	1,430,244.00	0.25
92	603998	方盛制药	155,900	1,407,777.00	0.25
93	300871	回盛生物	63,758	1,406,501.48	0.25
94	301293	三博脑科	28,920	1,393,365.60	0.24
95	002328	新朋股份	189,000	1,387,260.00	0.24
96	688089	嘉必优	128,600	1,364,446.00	0.24
97	300677	英科医疗	33,540	1,313,761.80	0.23
98	603516	淳中科技	9,700	1,305,717.00	0.23
99	301308	江波龙	1,800	1,266,840.00	0.22
100	300792	壹网壹创	48,600	1,260,684.00	0.22
101	002275	桂林三金	100,600	1,226,314.00	0.22
102	002412	汉森制药	212,100	1,166,550.00	0.20
103	002603	以岭药业	74,400	1,116,000.00	0.20
104	002166	莱茵生物	173,100	1,087,068.00	0.19
105	000950	重药控股	211,600	1,060,116.00	0.19
106	002821	凯莱英	6,500	1,053,000.00	0.18
107	688580	伟思医疗	19,400	1,033,438.00	0.18
108	301267	华夏眼科	70,600	1,030,054.00	0.18
109	600196	复星医药	44,627	1,002,768.69	0.18
110	300217	东方电热	227,000	969,290.00	0.17
111	603101	汇嘉时代	149,500	932,880.00	0.16
112	301081	严牌股份	67,500	923,400.00	0.16
113	688802	沐曦股份	1,198	921,130.22	0.16
114	600419	天润乳业	116,900	884,933.00	0.16

115	688410	山外山	61,475	882,781.00	0.16
116	688222	成都先导	27,200	873,392.00	0.15
117	300073	当升科技	17,800	855,112.00	0.15
118	605188	国光连锁	72,700	849,863.00	0.15
119	600616	金枫酒业	224,600	842,250.00	0.15
120	000026	飞亚达	38,300	824,982.00	0.14
121	603551	奥普科技	91,500	822,585.00	0.14
122	002264	新华都	145,200	818,928.00	0.14
123	605599	菜百股份	59,300	812,410.00	0.14
124	000919	金陵药业	138,900	809,787.00	0.14
125	300189	神农种业	187,100	808,272.00	0.14
126	601138	工业富联	11,100	800,865.00	0.14
127	300896	爱美客	9,100	793,520.00	0.14
128	300233	金城医药	63,700	789,880.00	0.14
129	688013	天臣医疗	31,200	769,704.00	0.14
130	002860	星帅尔	52,600	767,434.00	0.13
131	600267	海正药业	75,000	758,250.00	0.13
132	001318	阳光乳业	70,800	701,628.00	0.12
133	603600	永艺股份	79,000	700,730.00	0.12
134	002653	海思科	10,300	683,302.00	0.12
135	002841	视源股份	19,200	662,976.00	0.12
136	001338	永顺泰	76,300	640,157.00	0.11
137	002517	恺英网络	39,100	635,375.00	0.11
138	000061	农产品	111,800	626,080.00	0.11
139	605338	巴比食品	34,200	612,180.00	0.11
140	605318	法狮龙	5,400	609,444.00	0.11
141	600272	开开实业	58,500	593,190.00	0.10
142	002399	海普瑞	65,787	590,767.26	0.10
143	300498	温氏股份	47,400	583,968.00	0.10
144	688166	博瑞医药	16,600	581,166.00	0.10
145	300952	恒辉安防	33,100	575,940.00	0.10

146	001219	青岛食品	50,138	574,581.48	0.10
147	601089	福元医药	34,900	568,172.00	0.10
148	600189	泉阳泉	73,600	554,208.00	0.10
149	600557	康缘药业	46,100	542,597.00	0.10
150	300986	志特新材	31,600	541,940.00	0.10
151	600613	神奇制药	122,000	541,680.00	0.10
152	600651	飞乐音响	96,400	538,876.00	0.09
153	301216	万凯新材	22,700	521,873.00	0.09
154	300824	北鼎股份	68,600	492,548.00	0.09
155	301666	大普微	1,046	484,643.18	0.09
156	600356	恒丰纸业	64,600	478,686.00	0.08
157	600838	上海九百	66,600	476,190.00	0.08
158	600257	大湖股份	107,700	466,341.00	0.08
159	688378	奥来德	7,400	458,800.00	0.08
160	001359	平安电工	3,600	450,900.00	0.08
161	688110	东芯股份	2,200	448,140.00	0.08
162	300206	理邦仪器	36,300	443,949.00	0.08
163	300416	苏试试验	21,500	438,170.00	0.08
164	002636	金安国纪	3,600	431,892.00	0.08
165	603127	昭衍新药	11,100	424,242.00	0.07
166	300705	九典制药	43,000	420,540.00	0.07
167	603697	有友食品	43,800	420,042.00	0.07
168	002589	瑞康医药	168,200	413,772.00	0.07
169	688687	凯因科技	25,200	411,012.00	0.07
170	600829	人民同泰	51,900	402,744.00	0.07
171	600467	好当家	201,800	397,546.00	0.07
172	300272	开能健康	75,100	395,026.00	0.07
173	600113	浙江东日	11,900	394,842.00	0.07
174	300164	通源石油	49,200	393,600.00	0.07
175	002558	巨人网络	14,000	385,840.00	0.07
176	688293	奥浦迈	9,200	383,548.00	0.07

177	300973	立高食品	15,200	373,464.00	0.07
178	603351	威尔药业	15,200	371,032.00	0.07
179	300404	博济医药	41,900	367,044.00	0.06
180	601113	华鼎股份	109,300	360,690.00	0.06
181	301073	君亭酒店	19,600	356,720.00	0.06
182	002668	TCL智家	32,100	355,668.00	0.06
183	300058	蓝色光标	25,300	348,128.00	0.06
184	688468	科美诊断	60,800	345,952.00	0.06
185	003000	劲仔食品	34,700	342,142.00	0.06
186	603317	天味食品	26,200	340,862.00	0.06
187	600916	中国黄金	47,700	326,268.00	0.06
188	002826	易明医药	21,600	324,648.00	0.06
189	002317	众生药业	12,900	316,953.00	0.06
190	605007	五洲特纸	23,600	316,004.00	0.06
191	000404	长虹华意	39,300	308,898.00	0.05
192	688513	苑东生物	7,000	307,720.00	0.05
193	600966	博汇纸业	64,300	307,354.00	0.05
194	605289	罗曼股份	2,100	304,500.00	0.05
195	001248	华润新能源	29,828	301,561.08	0.05
196	605299	舒华体育	22,400	299,040.00	0.05
197	000848	承德露露	40,100	296,740.00	0.05
198	688626	翔宇医疗	6,692	296,187.92	0.05
199	300063	天龙集团	34,100	295,988.00	0.05
200	300534	陇神戎发	41,400	293,112.00	0.05
201	301363	美好医疗	15,940	292,180.20	0.05
202	002891	中宠股份	10,900	291,248.00	0.05
203	001309	德明利	300	282,870.00	0.05
204	601086	国芳集团	42,500	281,775.00	0.05
205	000529	广弘控股	63,900	272,214.00	0.05
206	002384	东山精密	1,000	262,350.00	0.05
207	002365	永安药业	25,900	262,108.00	0.05

208	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.05
209	688781	视涯科技	5,951	250,894.16	0.04
210	603538	美诺华	7,700	250,635.00	0.04
211	600865	百大集团	30,500	249,795.00	0.04
212	600738	丽尚国潮	68,800	247,680.00	0.04
213	300146	汤臣倍健	27,300	246,792.00	0.04
214	002852	道道全	34,700	246,023.00	0.04
215	300121	阳谷华泰	19,300	243,180.00	0.04
216	600882	妙可蓝多	14,300	228,657.00	0.04
217	300358	楚天科技	27,600	220,800.00	0.04
218	002836	新宏泽	23,600	218,064.00	0.04
219	300363	博腾股份	13,300	215,992.00	0.04
220	300003	乐普医疗	18,200	215,670.00	0.04
221	300979	华利集团	7,200	214,200.00	0.04
222	688531	日联科技	1,200	213,408.00	0.04
223	002290	禾盛新材	2,300	211,301.00	0.04
224	300247	融捷健康	57,000	209,190.00	0.04
225	600201	生物股份	17,500	203,875.00	0.04
226	002918	蒙娜丽莎	20,200	203,010.00	0.04
227	301277	新天地	22,900	200,375.00	0.04
228	300999	金龙鱼	8,600	200,036.00	0.04
229	301207	华兰疫苗	11,900	193,851.00	0.03
230	002297	博云新材	6,600	191,334.00	0.03
231	002940	昂利康	7,200	190,152.00	0.03
232	000001	平安银行	18,900	189,945.00	0.03
233	688617	惠泰医疗	1,000	181,560.00	0.03
234	600232	金鹰股份	28,100	177,030.00	0.03
235	300864	南大环境	9,200	176,456.00	0.03
236	605339	南侨食品	14,700	175,518.00	0.03
237	000798	中水渔业	24,300	171,558.00	0.03
238	300654	世纪天鸿	17,400	169,128.00	0.03

239	603676	卫信康	20,300	163,415.00	0.03
240	603986	兆易创新	200	163,000.00	0.03
241	002107	沃华医药	28,300	161,027.00	0.03
242	002415	海康威视	4,700	160,740.00	0.03
243	601988	中国银行	27,500	157,300.00	0.03
244	001322	箭牌家居	25,600	154,624.00	0.03
245	002404	嘉欣丝绸	27,000	154,440.00	0.03
246	603345	安井食品	1,900	152,361.00	0.03
247	301316	慧博云通	3,800	149,644.00	0.03
248	300453	三鑫医疗	16,500	149,160.00	0.03
249	688820	盛合晶微	1,042	147,432.58	0.03
250	300129	泰胜风能	16,600	141,930.00	0.02
251	300622	博士眼镜	10,100	140,794.00	0.02
252	002565	顺灏股份	11,000	139,370.00	0.02
253	300803	指南针	1,500	137,505.00	0.02
254	002644	佛慈制药	19,900	135,519.00	0.02
255	688273	麦澜德	3,400	131,716.00	0.02
256	600702	舍得酒业	3,700	131,535.00	0.02
257	605268	王力安防	14,600	131,108.00	0.02
258	605196	华通线缆	5,000	130,500.00	0.02
259	603889	新澳股份	25,500	130,305.00	0.02
260	300658	延江股份	11,400	130,302.00	0.02
261	000801	四川九洲	10,000	129,400.00	0.02
262	002677	浙江美大	23,300	128,849.00	0.02
263	000921	海信家电	4,700	128,404.00	0.02
264	601607	上海医药	8,200	126,280.00	0.02
265	002012	凯恩股份	19,600	125,636.00	0.02
266	600176	中国巨石	1,700	123,896.00	0.02
267	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.02
268	605080	浙江自然	6,200	119,412.00	0.02
269	002330	得利斯	34,300	118,678.00	0.02

270	300636	同和药业	18,380	117,080.60	0.02
271	603708	家家悦	13,600	116,688.00	0.02
272	002708	光洋股份	8,700	114,753.00	0.02
273	002602	世纪华通	7,900	111,390.00	0.02
274	001215	千味央厨	3,000	110,700.00	0.02
275	300785	值得买	3,000	110,010.00	0.02
276	300450	先导智能	2,700	109,944.00	0.02
277	300758	七彩化学	8,700	109,185.00	0.02
278	002475	立讯精密	1,500	105,600.00	0.02
279	001339	智微智能	1,030	105,348.40	0.02
280	301246	宏源药业	3,900	104,910.00	0.02
281	300277	汽轮科技	6,900	103,776.00	0.02
282	688516	奥特维	1,800	103,302.00	0.02
283	600938	中国海油	3,800	103,170.00	0.02
284	688315	诺禾致源	8,183	102,369.33	0.02
285	688388	嘉元科技	2,300	101,200.00	0.02
286	300881	盛德鑫泰	2,700	101,115.00	0.02
287	688717	艾罗能源	1,200	99,084.00	0.02
288	301498	乖宝宠物	2,400	97,416.00	0.02
289	301682	宏明电子	607	97,156.42	0.02
290	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.02
291	001399	惠科股份	3,478	96,444.94	0.02
292	000969	安泰科技	3,900	95,706.00	0.02
293	300400	劲拓股份	2,500	94,125.00	0.02
294	688073	毕得医药	1,724	92,785.68	0.02
295	300681	英搏尔	3,200	91,584.00	0.02
296	605138	盛泰集团	16,500	91,080.00	0.02
297	000869	张裕A	5,800	90,364.00	0.02
298	300993	玉马科技	8,800	85,536.00	0.02
299	000565	渝三峡A	14,700	83,496.00	0.01
300	300715	凯伦股份	5,000	82,300.00	0.01

301	603929	亚翔集成	300	81,606.00	0.01
302	300314	戴维医疗	8,500	79,135.00	0.01
303	600822	上海物贸	10,300	78,383.00	0.01
304	603579	荣泰健康	4,600	78,062.00	0.01
305	301529	福赛科技	800	77,088.00	0.01
306	600645	中源协和	4,500	76,995.00	0.01
307	603083	剑桥科技	300	76,461.00	0.01
308	601339	百隆东方	11,100	75,147.00	0.01
309	600103	青山纸业	24,000	73,680.00	0.01
310	603216	梦天家居	3,300	67,881.00	0.01
311	000506	招金黄金	5,700	66,804.00	0.01
312	002172	澳洋健康	23,600	66,552.00	0.01
313	600498	烽火通信	900	66,240.00	0.01
314	300987	川网传媒	5,200	63,960.00	0.01
315	600115	中国东航	16,700	63,627.00	0.01
316	300439	美康生物	7,900	63,437.00	0.01
317	000811	冰轮环境	1,100	61,842.00	0.01
318	603058	永吉股份	7,100	61,841.00	0.01
319	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
320	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
321	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
322	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
323	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
324	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
325	000017	深中华A	4,100	25,092.00	0.00
326	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
327	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
328	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
329	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
330	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
331	301687	新广益	195	15,167.10	0.00

332	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
333	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
334	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
335	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
336	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
337	601112	振石股份	604	10,624.36	0.00
338	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
339	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
340	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
341	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
342	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
343	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
344	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
345	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
346	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	51,489,116.50	8.34
2	000333	美的集团	39,990,124.00	6.48
3	600887	伊利股份	33,209,934.00	5.38
4	301093	华兰股份	30,469,162.80	4.93
5	000651	格力电器	30,140,154.79	4.88
6	301580	爱迪特	26,168,936.82	4.24
7	603259	药明康德	25,277,544.80	4.09
8	002429	兆驰股份	25,017,544.00	4.05
9	300760	迈瑞医疗	24,071,952.47	3.90

10	300584	海辰药业	23,827,540.00	3.86
11	688358	祥生医疗	22,956,148.65	3.72
12	688580	伟思医疗	22,070,022.87	3.57
13	001313	粤海饲料	21,600,520.00	3.50
14	300279	和晶科技	19,817,232.00	3.21
15	688301	奕瑞科技	19,295,725.21	3.12
16	300871	回盛生物	18,999,874.88	3.08
17	600690	海尔智家	18,611,203.08	3.01
18	002458	益生股份	18,416,325.00	2.98
19	600201	生物股份	18,235,266.00	2.95
20	603288	海天味业	18,230,184.00	2.95
21	002676	顺威股份	17,908,832.00	2.90
22	603387	基蛋生物	17,875,378.00	2.89
23	300016	北陆药业	16,856,172.00	2.73
24	002290	禾盛新材	16,792,285.00	2.72
25	000423	东阿阿胶	16,570,713.00	2.68
26	301363	美好医疗	15,796,715.00	2.56
27	605499	东鹏饮料	15,550,492.40	2.52
28	301257	普蕊斯	15,488,242.00	2.51
29	603739	蔚蓝生物	15,397,664.00	2.49
30	002050	三花智控	15,303,626.00	2.48
31	688108	赛诺医疗	15,006,505.78	2.43
32	300404	博济医药	14,837,021.00	2.40
33	688273	麦澜德	14,742,056.93	2.39
34	600809	山西汾酒	14,662,332.20	2.37
35	300916	朗特智能	14,585,490.00	2.36
36	603551	奥普科技	14,517,231.00	2.35
37	600196	复星医药	14,285,043.46	2.31
38	601138	工业富联	14,281,564.00	2.31
39	600189	泉阳泉	14,257,714.30	2.31
40	600276	恒瑞医药	14,107,064.00	2.28

41	301235	华康洁净	14,094,440.00	2.28
42	603216	梦天家居	13,953,769.00	2.26
43	002714	牧原股份	13,840,700.00	2.24
44	688222	成都先导	13,826,838.71	2.24
45	002826	易明医药	13,229,277.00	2.14
46	603127	昭衍新药	13,180,175.08	2.13
47	300973	立高食品	12,847,546.00	2.08
48	002788	鹭燕医药	12,808,014.00	2.07
49	300677	英科医疗	12,679,763.40	2.05
50	002420	毅昌科技	12,648,474.00	2.05
51	603696	安记食品	12,571,893.00	2.04
52	002695	煌上煌	12,410,678.06	2.01
53	002228	合兴包装	12,409,735.00	2.01

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

7.4.2 累计卖出金额超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	600519	贵州茅台	45,115,450.00	7.31
2	000333	美的集团	41,956,443.21	6.79
3	600276	恒瑞医药	38,715,810.68	6.27
4	600887	伊利股份	35,276,927.00	5.71
5	000651	格力电器	31,470,611.00	5.10
6	301093	华兰股份	30,465,882.68	4.93
7	603259	药明康德	30,137,240.63	4.88
8	301580	爱迪特	28,264,052.57	4.58
9	002429	兆驰股份	25,927,435.00	4.20
10	001313	粤海饲料	23,086,306.00	3.74

11	300871	回盛生物	22,827,170.00	3.70
12	688580	伟思医疗	22,455,088.60	3.64
13	300584	海辰药业	21,001,387.00	3.40
14	688222	成都先导	20,749,812.63	3.36
15	600690	海尔智家	20,201,983.68	3.27
16	603387	基蛋生物	20,041,581.00	3.25
17	002826	易明医药	19,206,217.00	3.11
18	600201	生物股份	18,726,727.00	3.03
19	300916	朗特智能	18,282,322.08	2.96
20	603288	海天味业	17,775,882.30	2.88
21	301257	普蕊斯	17,712,854.00	2.87
22	002290	禾盛新材	17,603,907.00	2.85
23	301230	泓博医药	17,475,002.42	2.83
24	000568	泸州老窖	17,330,218.50	2.81
25	300760	迈瑞医疗	16,512,599.00	2.67
26	300347	泰格医药	16,356,142.87	2.65
27	301363	美好医疗	16,242,386.32	2.63
28	000423	东阿阿胶	16,178,042.00	2.62
29	688358	祥生医疗	15,831,916.88	2.56
30	301235	华康洁净	15,792,486.28	2.56
31	603027	千禾味业	15,447,618.64	2.50
32	603551	奥普科技	15,226,851.00	2.47
33	002695	煌上煌	15,174,370.00	2.46
34	603127	昭衍新药	15,118,325.04	2.45
35	300453	三鑫医疗	15,054,337.00	2.44
36	688273	麦澜德	14,843,941.60	2.40
37	300404	博济医药	14,800,983.00	2.40
38	300973	立高食品	14,627,925.00	2.37
39	601138	工业富联	14,550,408.00	2.36
40	688301	奕瑞科技	14,330,251.28	2.32
41	002345	潮宏基	14,178,966.00	2.30

42	600189	泉阳泉	14,028,441.00	2.27
43	600613	神奇制药	13,920,785.00	2.25
44	002458	益生股份	13,919,696.39	2.25
45	301055	张小泉	13,644,249.00	2.21
46	688108	赛诺医疗	13,602,970.53	2.20
47	301110	青木科技	13,486,340.03	2.18
48	300016	北陆药业	13,243,191.00	2.14
49	603697	有友食品	13,133,973.40	2.13
50	002615	哈尔斯	13,048,926.00	2.11
51	002676	顺威股份	12,953,736.00	2.10
52	600704	物产中大	12,865,228.00	2.08
53	603216	梦天家居	12,846,535.00	2.08
54	605499	东鹏饮料	12,701,960.70	2.06
55	603739	蔚蓝生物	12,581,250.00	2.04
56	300759	康龙化成	12,406,115.04	2.01
57	300314	戴维医疗	12,369,033.00	2.00

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,240,867,422.44
卖出股票收入（成交）总额	3,240,510,204.36

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	29,391,030.43	5.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,391,030.43	5.16

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019827	26国债01	152,000	15,298,525.15	2.69
2	019792	25国债19	105,390	10,649,578.65	1.87
3	019785	25国债13	34,000	3,442,926.63	0.60

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

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

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策
无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
无。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	258,727.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	258,727.50

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有	户均持有的 基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	人 户 数 (户)		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
博道 消费 智航A	5,102	36,193.18	23,505,654.93	12.73%	161,151,968.10	87.27%
博道 消费 智航C	20,504	23,185.17	384,970,158.77	80.98%	90,418,591.00	19.02%
合计	25,422	25,963.59	408,475,813.70	61.89%	251,570,559.10	38.11%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025年07月01日-2026年06月30日）
盈利投资者数量占比	24.15%

8.3 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	博道消费智航A	115,973.04	0.06%
	博道消费智航C	35.12	0.00%
	合计	116,008.16	0.02%

8.4 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	博道消费智航A	0
	博道消费智航C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基	博道消费智航A	0

金	博道消费智航C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道消费智航A	博道消费智航C
基金合同生效日(2021年05月07日)基金份额总额	590,493,121.54	-
本报告期期初基金份额总额	285,520,987.79	384,707,061.93
本报告期基金总申购份额	38,092,223.66	382,741,111.50
减：本报告期基金总赎回份额	138,955,588.42	292,059,423.66
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	184,657,623.03	475,388,749.77

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；
3、本基金自2023年6月20日起增设C类基金份额，该类份额首次确认日为2023年6月21日，增设当年的相关数据和指标按实际存续期计算。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为容诚会计师事务所(特殊普通合伙)。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。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	2,365,934,607.84	36.52%	1,031,448.09	36.52%	-
浙商证券	2	4,112,695,163.00	63.48%	1,792,954.60	63.48%	-

10.7.2 基金租用或者通过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	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总	成交金额	占当期基金成交总

		额的比例		交总额的 比例		额的比例		额的比例
东方证 券	15,851,116. 93	41.73%	93,042,000.0 0	44.40%	-	-	-	-
浙商证 券	22,132,763. 00	58.27%	116,532,000. 00	55.60%	-	-	-	-

注：

- 1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；
- 2、基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：

(1) 经营行为稳健规范，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提供证券交易服务的证券公司；

(2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订相关协议。
- 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》。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2026-01-22
2	博道消费智航股票型证券投资基金2025年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-22
3	博道消费智航股票型证券投资基金（更新）招募说明书（2026年第1号）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-27
4	博道消费智航股票型证券投资基金基金产品资料概要更	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-27

	新		
5	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（2025年度）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
6	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	2026-03-31
7	博道消费智航股票型证券投资基金2025年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
8	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	2026-04-22
9	博道消费智航股票型证券投资基金2026年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-22
10	博道基金管理有限公司关于博道消费智航股票型证券投资基金的基金经理变更公告	上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-30
11	2025年度博道基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-30
12	博道消费智航股票型证券投资基金（更新）招募说明书（2026年第2号）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-06
13	博道消费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	2026-05-06
14	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人关联方承销证券的公告	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	2026-05-12
15	博道基金管理有限公司关于提醒客户及时提供或更新身	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司	2026-06-03

	份信息资料的公告	网站、中国证监会基金电子披露网站	
--	----------	------------------	--

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道消费智航股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道消费智航股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道消费智航股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道消费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消费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、报告期内博道消费智航股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

11.3 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
二〇二六年八月三十一日