

博道启航混合型证券投资基金

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:国泰海通证券股份有限公司

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。

基金托管人国泰海通证券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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
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	12
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	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	70
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	70
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	70
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	70
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
7.12 投资组合报告附注	70
§8 基金份额持有人信息	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
8.2 盈利投资者数量占比	72

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
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	72
§9 开放式基金份额变动	73
§10 重大事件揭示	73
10.1 基金份额持有人大会决议	73
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	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
10.4 基金投资策略的改变	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	73
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	74
10.8 其他重大事件	75
§11 影响投资者决策的其他重要信息	77
11.1 影响投资者决策的其他重要信息	77
§12 备查文件目录	77
12.1 备查文件目录	77
12.2 存放地点	77
12.3 查阅方式	77

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道启航混合型证券投资基金	
基金简称	博道启航混合	
基金主代码	006160	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年08月10日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	133,426,980.91份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道启航混合A	博道启航混合C
下属分级基金的交易代码	006160	006161
报告期末下属分级基金的份额总额	81,562,275.67份	51,864,705.24份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金根据对宏观基本面、指数价量特征、风险偏好、资金流向等多方面因素的分析，确定和调整资产配置比例，参照多因子选股思路挑选个股构建股票组合，根据对利率、经济周期、宏观政策等因素的分析构建债券组合。本基金的可转换债券和可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博道基金管理有限公司	国泰海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛	帅芳
	联系电话	021-80226288	021-38677947
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	tgrxp@tg.gtht.com
客户服务电话		400-085-2888	021-38917599-5
传真		021-80226289	021-50872603
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼
邮政编码		200122	200041
法定代表人		莫泰山	朱健

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)
---------------	----------------------------------

	博道启航混合A	博道启航混合C
本期已实现收益	26,644,749.83	19,166,853.14
本期利润	34,542,581.57	23,452,225.76
加权平均基金份额本期利润	0.4462	0.3606
本期加权平均净值利润率	18.74%	15.86%
本期基金份额净值增长率	20.58%	20.28%
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	127,110,389.82	75,377,573.68
期末可供分配基金份额利润	1.5584	1.4534
期末基金资产净值	218,085,040.73	132,919,424.39
期末基金份额净值	2.6738	2.5628
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	202.66%	190.93%

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

博道启航混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	22.05%	1.49%	8.61%	0.88%	13.44%	0.61%
过去六个月	20.58%	1.34%	5.90%	0.79%	14.68%	0.55%
过去一年	44.69%	1.12%	18.63%	0.71%	26.06%	0.41%
过去三年	77.63%	1.17%	25.45%	0.77%	52.18%	0.40%

过去五年	52.91%	1.13%	4.37%	0.78%	48.54%	0.35%
过去七年	156.00%	1.16%	33.90%	0.81%	122.10%	0.35%
自基金合同生效起至今	202.66%	1.15%	48.02%	0.85%	154.64%	0.30%

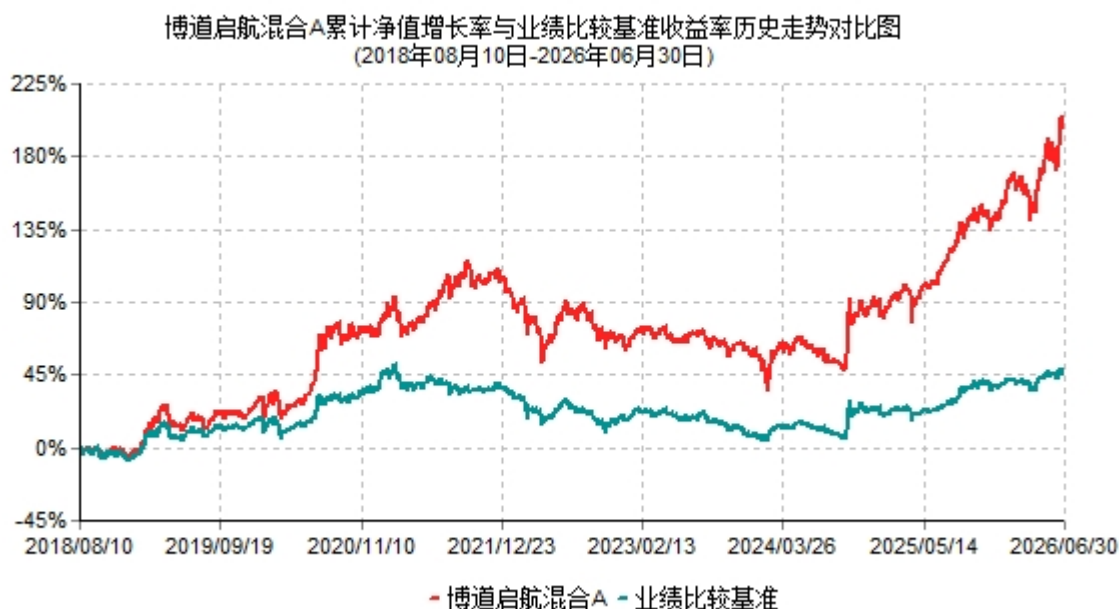
注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

博道启航混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	21.89%	1.49%	8.61%	0.88%	13.28%	0.61%
过去六个月	20.28%	1.34%	5.90%	0.79%	14.38%	0.55%
过去一年	43.97%	1.12%	18.63%	0.71%	25.34%	0.41%
过去三年	74.97%	1.17%	25.45%	0.77%	49.52%	0.40%
过去五年	49.13%	1.13%	4.37%	0.78%	44.76%	0.35%
过去七年	147.18%	1.16%	33.90%	0.81%	113.28%	0.35%
自基金合同生效起至今	190.93%	1.15%	48.02%	0.85%	142.91%	0.30%

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。

§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	2026-05-21	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	2026-05-21	-	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，产品一直坚持按照系统化投资的思路运作：50%的沪深300增强模型+50%的中证500增强模型，在此基础上，叠加小幅度的仓位管理，以及沪深300与中证500间的风格轮动，来适当平抑波动。

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，国泰海通证券股份有限公司（以下称"本托管人"）在博道启航混合型证券投资基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、利润分配等情况进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核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，认为其真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博道启航混合型证券投资基金

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	9,015,310.78	14,734,857.16

结算备付金		102,326.41	101,720.78
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	342,064,877.01	312,683,882.19
其中：股票投资		324,223,874.30	295,924,403.10
基金投资		-	-
债券投资		17,841,002.71	16,759,479.09
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		1,428,375.40	168,906.30
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		352,610,889.60	327,689,366.43
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		1,087,988.80	565,310.64
应付管理人报酬		316,596.01	351,039.35
应付托管费		52,765.99	58,506.58
应付销售服务费		51,336.24	69,716.05
应付投资顾问费		-	-

应交税费		353.44	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	97,384.00	150,682.24
负债合计		1,606,424.48	1,195,254.86
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	133,426,980.91	149,922,920.69
未分配利润	6.4.7.7	217,577,484.21	176,571,190.88
净资产合计		351,004,465.12	326,494,111.57
负债和净资产总计		352,610,889.60	327,689,366.43

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：博道启航混合型证券投资基金

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		60,745,932.94	33,546,575.79
1.利息收入		73,388.57	48,612.26
其中：存款利息收入	6.4.7.8	73,388.42	48,612.14
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		0.15	0.12
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		48,385,459.88	25,094,192.84
其中：股票投资收益	6.4.7.9	46,414,369.41	21,502,318.10

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	132,024.91	91,193.29
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	1,839,065.56	3,500,681.45
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	12,183,204.36	8,378,969.37
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	103,880.13	24,801.32
减：二、营业总支出		2,751,125.61	2,408,958.09
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,978,659.57	1,767,448.75
2.托管费	6.4.10.2.2	329,776.55	294,574.75
3.销售服务费		368,181.19	270,277.58
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	2,273.21
其中：卖出回购金融资产 支出		-	2,273.21
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		124.54	0.04
8.其他费用	6.4.7.16	74,383.76	74,383.76
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		57,994,807.33	31,137,617.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		57,994,807.33	31,137,617.70
五、其他综合收益的税后 净额		-	-

六、综合收益总额		57,994,807.33	31,137,617.70
----------	--	---------------	---------------

6.3 净资产变动表

会计主体：博道启航混合型证券投资基金

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、上期期末净资产	149,922,920.69	176,571,190.88	326,494,111.57
二、本期期初净资产	149,922,920.69	176,571,190.88	326,494,111.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,495,939.78	41,006,293.33	24,510,353.55
（一）、综合收益总额	-	57,994,807.33	57,994,807.33
（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）	-16,495,939.78	-16,988,514.00	-33,484,453.78
其中：1.基金申购款	71,782,564.12	97,882,906.48	169,665,470.60
2.基金赎回款	-88,278,503.90	-114,871,420.48	-203,149,924.38
（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	133,426,980.91	217,577,484.21	351,004,465.12

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	197,695,097.39	127,967,560.14	325,662,657.53
二、本期期初净资产	197,695,097.39	127,967,560.14	325,662,657.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-17,913,814.39	19,046,066.19	1,132,251.80
（一）、综合收益总额	-	31,137,617.70	31,137,617.70
（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）	-17,913,814.39	-12,091,551.51	-30,005,365.90
其中：1.基金申购款	73,543,842.62	48,481,793.04	122,025,635.66
2.基金赎回款	-91,457,657.01	-60,573,344.55	-152,031,001.56
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	179,781,283.00	147,013,626.33	326,794,909.33

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

博道启航混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1056号《关于准予博道启航混合型证券投资基金注册的批复》注册，由博道基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道启航混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币724,415,554.56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（2018）第0536号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道启航混合型证券投资基金基金合同》于2018年8月10日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为724,709,126.66份基金份额，其中认购资金利息折合293,572.10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，基金托管人为国泰海通证券股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道启航混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为50%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可

以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%。

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	2,105,944.53
等于：本金	2,105,130.99
加：应计利息	813.54
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	6,909,366.25
等于：本金	6,907,278.11
加：应计利息	2,088.14
减：坏账准备	-
合计	9,015,310.78

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		306,192,183.39	-	324,223,874.30	18,031,690.91
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	17,702,319.55	132,032.71	17,841,002.71	6,650.45
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,702,319.55	132,032.71	17,841,002.71	6,650.45
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	323,894,502.94	132,032.71	342,064,877.01	18,038,341.36

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	182.84
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	22,817.40
合计	97,384.00

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 博道启航混合A

金额单位：人民币元

项目 (博道启航混合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	81,264,943.56	81,264,943.56
本期申购	24,790,772.00	24,790,772.00
本期赎回（以“-”号填列）	-24,493,439.89	-24,493,439.89
本期末	81,562,275.67	81,562,275.67

6.4.7.6.2 博道启航混合C

金额单位：人民币元

项目 (博道启航混合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	68,657,977.13	68,657,977.13
本期申购	46,991,792.12	46,991,792.12
本期赎回（以“-”号填列）	-63,785,064.01	-63,785,064.01
本期末	51,864,705.24	51,864,705.24

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 博道启航混合A

单位：人民币元

项目 (博道启航混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	99,121,287.03	-183,850.27	98,937,436.76
本期期初	99,121,287.03	-183,850.27	98,937,436.76
本期利润	26,644,749.83	7,897,831.74	34,542,581.57
本期基金份额交易产生的变动数	1,344,352.96	1,698,393.77	3,042,746.73
其中：基金申购款	34,503,523.83	1,968,265.12	36,471,788.95

基金赎回款	-33,159,170.87	-269,871.35	-33,429,042.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	127,110,389.82	9,412,375.24	136,522,765.06

6.4.7.7.2 博道启航混合C

单位：人民币元

项目 (博道启航混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	77,864,440.02	-230,685.90	77,633,754.12
本期期初	77,864,440.02	-230,685.90	77,633,754.12
本期利润	19,166,853.14	4,285,372.62	23,452,225.76
本期基金份额交易产生的变动数	-21,653,719.48	1,622,458.75	-20,031,260.73
其中：基金申购款	59,662,340.63	1,748,776.90	61,411,117.53
基金赎回款	-81,316,060.11	-126,318.15	-81,442,378.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	75,377,573.68	5,677,145.47	81,054,719.15

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	16,419.06
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	56,363.73
结算备付金利息收入	605.63
其他	-
合计	73,388.42

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	2,067,588,579.89
减：卖出股票成本总额	2,018,090,162.82
减：交易费用	3,084,047.66
买卖股票差价收入	46,414,369.41

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	110,201.11
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	21,823.80
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	132,024.91

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	13,298,642.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,124,152.01
减：应计利息总额	152,439.01
减：交易费用	227.96
买卖债券差价收入	21,823.80

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	1,839,065.56
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,839,065.56

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	12,183,204.36
——股票投资	12,183,471.14
——债券投资	-266.78
——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	12,183,204.36

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	100,981.36
转换费收入	2,898.77
合计	103,880.13

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
合计	74,383.76

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
国泰海通证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	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
国泰海通证券股份有限公司	4,099,957,093.25	100.00%	2,343,056,144.52	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
国泰海通证券股份有限公司	22,551,407.40	100.00%	18,076,054.68	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	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
国泰海通 证券股份 有限公司	2,000.00	100.00%	31,302,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
国泰海通 证券股份 有限公司	1,787,645.68	100.00%	-	-
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
国泰海通 证券股份	1,021,750.45	100.00%	-	-

有限公司				
------	--	--	--	--

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。

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20 26年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至20 25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,978,659.57	1,767,448.75
其中：应支付销售机构的客户维护费	561,243.74	450,172.29
应支付基金管理人的净管理费	1,417,415.83	1,317,276.46

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 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托管费	329,776.55	294,574.75

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	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
--------------	-------------------------------

各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道启航混合A	博道启航混合C	合计
博道基金管理有限公司	-	11,780.60	11,780.60
国泰海通证券股份有限公司	-	57,449.35	57,449.35
合计	-	69,229.95	69,229.95
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		
	博道启航混合A	博道启航混合C	合计
博道基金管理有限公司	-	6,945.99	6,945.99
国泰海通证券股份有限公司	-	62,963.25	62,963.25
合计	-	69,909.24	69,909.24

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

博道启航混合C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2026年01月01日至 2026年06月30日	2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	700,315.00	700,315.00
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	700,315.00	700,315.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.35%	0.88%

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；
- 4、除上述情况外，报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金其他类别份额。

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10~50万份。（上年度末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为10~50万份。）

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
国泰海通 证券股份 有限公司	6,909,366.25	56,363.73	6,246,164.41	27,539.82

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026年01月01日至2026年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
国泰海通证券股份有限公司	688818	电科蓝天	网下发行	10,055	95,220.85
国泰海通证券股份有限公司	688781	视涯科技	网下发行	5,256	119,206.08
国泰海通证券股份有限公司	301696	三瑞智能	网下发行	2,031	50,125.08
国泰海通证券股份有限公司	301666	大普微	网下发行	1,241	57,185.28
国泰海通证券股份有限公司	301599	理奇智能	网下发行	3,932	54,694.12
国泰海通证券股份有限公司	688635	长进光子	网下发行	1,271	52,085.58
上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
国泰海通证券股份有限公司	688545	兴福电子	网下发行	9,940	116,099.20
国泰海通	301173	毓恬冠佳	网下发行	1,724	48,840.92

证券股份有限公司					
国泰海通证券股份有限公司	301535	浙江华远	网下发行	7,336	36,093.12
国泰海通证券股份有限公司	301658	首航新能	网下发行	4,369	51,554.20

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	科创板打新限售	104.66	768.89	999	104,555.34	768,121.11	-
301666	大普微	2026-04-08	6个月	创业板打新限售	46.08	463.33	497	22,901.76	230,275.01	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9个月	科创板打新限售	22.68	42.16	3,417	77,497.56	144,060.72	-

688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	科创板打新限售	81.88	1,584.33	79	6,468.52	125,162.07	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6个月	主板打新限售	10.11	10.11	10,794	109,127.34	109,127.34	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	科创板打新限售	9.47	70.14	1,006	9,526.82	70,560.84	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	科创板打新限售	19.68	141.49	468	9,210.24	66,217.32	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6个月	科创板打新限售	44.56	468.67	127	5,659.12	59,521.09	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月	创业板打新限售	69.66	160.06	346	24,102.36	55,380.76	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	科创板打新限售	17.52	35.92	1,408	24,668.16	50,575.36	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6个月	主板打新限售	10.12	27.73	1,687	17,072.44	46,780.51	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1个月内(含)	新股未上市	10.11	10.11	4,625	46,758.75	46,758.75	-

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	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	科创板打新限售	92.18	463.15	85	7,835.30	39,367.75	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月	主板打新限售	7.82	20.74	1,436	11,229.52	29,782.64	-
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	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月	创业板打新限售	24.68	86.80	204	5,034.72	17,707.20	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	主板打新限售	17.70	84.32	210	3,717.00	17,707.20	-
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	-

				售						
3015 31	春光 集团	2026 -04-2 8	6个月	创业 板打 新限售	13.30	51.56	290	3,85 7.00	14,95 2.40	-
3016 80	固德 电材	2026 -02-2 7	6个月	创业 板打 新限售	58.00	112.1 6	117	6,78 6.00	13,12 2.72	-
3015 99	理奇 智能	2026 -04-2 2	6个月	创业 板打 新限售	13.91	32.47	394	5,48 0.54	12,79 3.18	-
0013 65	天海 电子	2026 -05-1 1	6个月	主板 打新 限售	27.19	31.31	333	9,05 4.27	10,42 6.23	-
6034 07	长裕 集团	2026 -04-2 9	6个月	主板 打新 限售	13.86	73.46	137	1,89 8.82	10,06 4.02	-
3016 83	慧谷 新材	2026 -03-2 4	6个月	创业 板打 新限售	78.38	121.7 7	79	6,19 2.02	9,61 9.83	-
0013 93	维通 利	2026 -05-0 8	6个月	主板 打新 限售	30.38	38.99	235	7,13 9.30	9,16 2.65	-
6888 16	易思 维	2026 -02-0 4	6个月	科创 板打 新限售	55.95	57.10	139	7,77 7.05	7,93 6.90	-
0012 37	惠康 科技	2026 -05-1 5	6个月	主板 打新 限售	53.26	58.74	135	7,19 0.10	7,92 9.90	-

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	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	主板打新限售	11.18	17.59	319	3,566.42	5,611.21	-
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	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月	主板打新限售	18.38	16.78	118	2,168.84	1,980.04	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	主板打新限售	33.49	33.93	58	1,942.42	1,967.94	-
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	主板打新限售	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

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

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

于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：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0.01%)。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于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0.61%。

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349,388,658.66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	9,015,310.78	-	-	-	-	-	9,015,310.78
结算备付金	102,326.41	-	-	-	-	-	102,326.41
交易性金融资产	5,265,652.49	-	12,575,350.22	-	-	324,223,874.30	342,064,877.01
应收申购款	-	-	-	-	-	1,428,375.40	1,428,375.40
资产总计	14,383,289.68	-	12,575,350.22	-	-	325,652,249.70	352,610,889.60
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	1,087,988.80	1,087,988.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	316,596.01	316,596.01
应付托管费	-	-	-	-	-	52,765.99	52,765.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-	51,336.24	51,336.24
应交税费	-	-	-	-	-	353.44	353.44
其他负债	-	-	-	-	-	97,384.00	97,384.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,606,424.48	1,606,424.48
利率敏感度缺口	14,383,289.68	-	12,575,350.22	-	-	324,045,825.22	351,004,465.12
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	14,734,857.16	-	-	-	-	-	14,734,857.16
结算备付金	101,720.78	-	-	-	-	-	101,720.78
交易性金融资产	-	-	16,735,477.09	-	24,002.00	295,924,403.10	312,683,882.19
应收申购款	-	-	-	-	-	168,906.30	168,906.30
资产总计	14,836,577.94	-	16,735,477.09	-	24,002.00	296,093,309.40	327,689,366.43
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	565,310.64	565,310.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	351,039.35	351,039.35

应付托管费	-	-	-	-	-	58,506.58	58,506.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-	69,716.05	69,716.05
其他负债	-	-	-	-	-	150,682.24	150,682.24
负债总计	-	-	-	-	-	1,195,254.86	1,195,254.86
利率敏感度缺口	14,836,577.94	-	16,735,477.09	-	24,002.00	294,898,054.54	326,494,111.57

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5.08%(2025年12月31日：5.13%)，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占基金资产的50%-95%，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，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。

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	324,223,874.30	92.37	295,924,403.10	90.64
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	324,223,874.30	92.37	295,924,403.10	90.64

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300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.沪深300指数收益率上升	23,649,886.77	18,616,495.75

	5%		
	2.沪深300指数收益率下降5%	-23,649,886.77	-18,616,495.75

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	322,092,750.27	294,332,453.83
第二层次	17,996,888.80	16,846,170.09
第三层次	1,975,237.94	1,505,258.27
合计	342,064,877.01	312,683,882.19

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	324,223,874.30	91.95
	其中：股票	324,223,874.30	91.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,841,002.71	5.06
	其中：债券	17,841,002.71	5.06
	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	9,117,637.19	2.59
8	其他各项资产	1,428,375.40	0.41
9	合计	352,610,889.60	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	-	-
B	采矿业	12,694,345.64	3.62
C	制造业	246,032,600.54	70.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,922,288.06	0.83
E	建筑业	1,812,568.00	0.52
F	批发和零售业	4,840,152.00	1.38
G	交通运输、仓储和邮政业	3,901,674.46	1.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,874,552.60	2.53
J	金融业	35,373,287.00	10.08
K	房地产业	65,987.00	0.02
L	租赁和商务服务业	1,288,324.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	3,168,009.00	0.90
N	水利、环境和公共设施管理业	3,084,278.00	0.88
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	165,808.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	324,223,874.30	92.37

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	300308	中际旭创	9,100	11,557,000.00	3.29
2	300750	宁德时代	17,623	6,926,015.23	1.97

3	603986	兆易创新	7,200	5,868,000.00	1.67
4	300502	新易盛	9,220	5,596,540.00	1.59
5	002384	东山精密	19,000	4,984,650.00	1.42
6	001309	德明利	5,000	4,714,500.00	1.34
7	601138	工业富联	61,500	4,437,225.00	1.26
8	600030	中信证券	153,200	4,401,436.00	1.25
9	600036	招商银行	107,083	3,801,446.50	1.08
10	300857	协创数据	10,020	3,405,798.00	0.97
11	000776	广发证券	145,200	3,397,680.00	0.97
12	600999	招商证券	160,100	3,378,110.00	0.96
13	300475	香农芯创	10,600	3,180,000.00	0.91
14	688256	寒武纪	1,992	3,178,335.60	0.91
15	002916	深南电路	6,800	3,113,720.00	0.89
16	301377	鼎泰高科	5,500	3,029,950.00	0.86
17	002475	立讯精密	42,300	2,977,920.00	0.85
18	688981	中芯国际	18,200	2,890,524.00	0.82
19	002716	湖南白银	357,100	2,888,939.00	0.82
20	002415	海康威视	84,200	2,879,640.00	0.82
21	002281	光迅科技	11,200	2,877,728.00	0.82
22	603993	洛阳钼业	163,000	2,860,650.00	0.81
23	002851	麦格米特	17,100	2,858,778.00	0.81
24	600519	贵州茅台	2,406	2,852,288.94	0.81
25	603588	高能环境	144,500	2,774,400.00	0.79
26	000657	中钨高新	28,200	2,699,304.00	0.77
27	300073	当升科技	55,600	2,671,024.00	0.76
28	603083	剑桥科技	10,300	2,625,161.00	0.75
29	301308	江波龙	3,600	2,533,680.00	0.72
30	688110	东芯股份	12,400	2,525,880.00	0.72
31	002938	鹏鼎控股	23,400	2,465,892.00	0.70
32	001359	平安电工	19,530	2,446,132.50	0.70
33	601988	中国银行	422,300	2,415,556.00	0.69

34	601318	中国平安	50,497	2,410,726.78	0.69
35	601398	工商银行	338,200	2,391,074.00	0.68
36	002969	嘉美包装	158,300	2,228,864.00	0.63
37	600498	烽火通信	30,000	2,208,000.00	0.63
38	002600	领益智造	125,900	2,183,106.00	0.62
39	002636	金安国纪	18,100	2,171,457.00	0.62
40	000534	万泽股份	78,700	2,153,232.00	0.61
41	002080	中材科技	23,700	2,133,000.00	0.61
42	300760	迈瑞医疗	15,400	2,091,782.00	0.60
43	688353	华盛锂电	17,400	2,019,618.00	0.58
44	300416	苏试试验	99,000	2,017,620.00	0.57
45	300604	长川科技	5,900	2,014,378.00	0.57
46	000333	美的集团	26,579	2,007,511.87	0.57
47	002328	新朋股份	268,800	1,972,992.00	0.56
48	688378	奥来德	31,394	1,946,428.00	0.55
49	300121	阳谷华泰	141,400	1,781,640.00	0.51
50	603228	景旺电子	24,600	1,781,286.00	0.51
51	688041	海光信息	4,665	1,727,449.50	0.49
52	688235	百济神州	6,687	1,702,577.07	0.49
53	603516	淳中科技	12,600	1,696,086.00	0.48
54	002534	西子洁能	90,800	1,684,340.00	0.48
55	601872	招商轮船	95,500	1,677,935.00	0.48
56	600875	东方电气	58,300	1,677,291.00	0.48
57	002517	恺英网络	102,700	1,668,875.00	0.48
58	600938	中国海油	60,100	1,631,715.00	0.46
59	300014	亿纬锂能	24,301	1,580,294.03	0.45
60	301150	中一科技	24,180	1,525,999.80	0.43
61	601288	农业银行	248,800	1,510,216.00	0.43
62	688766	普冉股份	1,961	1,503,302.60	0.43
63	688531	日联科技	8,400	1,493,856.00	0.43
64	600115	中国东航	383,900	1,462,659.00	0.42

65	001339	智微智能	14,260	1,458,512.80	0.42
66	002643	万润股份	66,500	1,393,175.00	0.40
67	300164	通源石油	172,600	1,380,800.00	0.39
68	300450	先导智能	33,600	1,368,192.00	0.39
69	301086	鸿富瀚	6,480	1,356,134.40	0.39
70	000703	恒逸石化	99,600	1,351,572.00	0.39
71	300373	扬杰科技	8,500	1,336,455.00	0.38
72	601899	紫金矿业	52,800	1,327,392.00	0.38
73	688525	佰维存储	2,633	1,302,624.09	0.37
74	601998	中信银行	182,400	1,264,032.00	0.36
75	301200	大族数控	3,500	1,262,275.00	0.36
76	300129	泰胜风能	145,400	1,243,170.00	0.35
77	600309	万华化学	18,100	1,238,221.00	0.35
78	600176	中国巨石	16,900	1,231,672.00	0.35
79	002001	新 和 成	42,600	1,210,692.00	0.34
80	000001	平安银行	119,400	1,199,970.00	0.34
81	605117	德业股份	11,200	1,189,216.00	0.34
82	601208	东材科技	15,900	1,125,561.00	0.32
83	000426	兴业银锡	34,000	1,120,640.00	0.32
84	603019	中科曙光	10,300	1,104,469.00	0.31
85	600816	建元信托	450,800	1,099,952.00	0.31
86	300803	指南针	11,800	1,081,706.00	0.31
87	603799	华友钴业	22,200	1,071,372.00	0.31
88	301369	联动科技	4,325	1,059,625.00	0.30
89	600601	方正科技	76,400	1,057,376.00	0.30
90	300548	长芯博创	3,700	1,028,600.00	0.29
91	300102	乾照光电	39,100	1,018,164.00	0.29
92	600809	山西汾酒	9,200	1,006,204.00	0.29
93	601166	兴业银行	60,687	1,004,976.72	0.29
94	002049	紫光国微	11,300	1,002,875.00	0.29
95	000811	冰轮环境	17,500	983,850.00	0.28

96	301165	锐捷网络	12,100	973,445.00	0.28
97	000949	新乡化纤	149,600	948,464.00	0.27
98	601869	长飞光纤	1,700	928,030.00	0.26
99	000987	越秀资本	117,700	920,414.00	0.26
100	600739	辽宁成大	90,400	913,944.00	0.26
101	300870	欧陆通	2,600	898,794.00	0.26
102	605196	华通线缆	34,400	897,840.00	0.26
103	300059	东方财富	43,800	892,644.00	0.25
104	002662	峰璟股份	240,700	890,590.00	0.25
105	300054	鼎龙股份	8,400	890,148.00	0.25
106	688347	华虹宏力	2,600	874,380.00	0.25
107	603259	药明康德	7,000	871,570.00	0.25
108	300758	七彩化学	67,300	844,615.00	0.24
109	603929	亚翔集成	3,100	843,262.00	0.24
110	000969	安泰科技	33,800	829,452.00	0.24
111	002156	通富微电	10,800	819,396.00	0.23
112	688358	祥生医疗	26,747	817,655.79	0.23
113	002222	福晶科技	8,700	802,836.00	0.23
114	600887	伊利股份	33,400	800,264.00	0.23
115	002432	九安医疗	11,200	791,616.00	0.23
116	600546	山煤国际	71,200	778,216.00	0.22
117	688239	航宇科技	12,999	777,730.17	0.22
118	601939	建设银行	79,900	769,437.00	0.22
119	688802	沐曦股份	999	768,121.11	0.22
120	300400	劲拓股份	20,200	760,530.00	0.22
121	605289	罗曼股份	5,000	725,000.00	0.21
122	603893	瑞芯微	3,800	715,768.00	0.20
123	603061	金海通	1,400	703,108.00	0.20
124	600549	厦门钨业	8,200	698,640.00	0.20
125	688388	嘉元科技	15,720	691,680.00	0.20
126	688516	奥特维	12,000	688,680.00	0.20

127	300905	宝丽迪	13,500	683,100.00	0.19
128	000960	锡业股份	15,900	678,771.00	0.19
129	000506	招金黄金	57,900	678,588.00	0.19
130	002648	卫星化学	28,700	674,163.00	0.19
131	300322	硕贝德	26,500	667,800.00	0.19
132	002478	常宝股份	107,100	661,878.00	0.19
133	300638	广和通	35,700	660,807.00	0.19
134	600487	亨通光电	6,000	656,040.00	0.19
135	688120	华海清科	2,000	644,360.00	0.18
136	301093	华兰股份	4,700	637,461.00	0.18
137	002008	大族激光	4,200	630,462.00	0.18
138	002792	通宇通讯	17,300	615,361.00	0.18
139	002676	顺威股份	121,900	607,062.00	0.17
140	000408	藏格矿业	8,400	582,288.00	0.17
141	688159	有方科技	13,000	577,070.00	0.16
142	002397	梦洁股份	148,900	568,798.00	0.16
143	600226	亨通股份	59,200	567,728.00	0.16
144	300988	津荣天宇	36,220	566,118.60	0.16
145	300681	英搏尔	19,700	563,814.00	0.16
146	688012	中微公司	1,200	562,200.00	0.16
147	601600	中国铝业	68,300	561,426.00	0.16
148	688266	泽璟制药	4,800	559,968.00	0.16
149	000895	双汇发展	24,700	553,280.00	0.16
150	603489	八方股份	19,780	553,048.80	0.16
151	300986	志特新材	31,400	538,510.00	0.15
152	002371	北方华创	600	530,736.00	0.15
153	688717	艾罗能源	6,400	528,448.00	0.15
154	688677	海泰新光	5,200	525,876.00	0.15
155	002429	兆驰股份	50,600	525,734.00	0.15
156	300223	北京君正	2,100	522,690.00	0.15
157	002558	巨人网络	18,800	518,128.00	0.15

158	603790	雅运股份	24,200	516,428.00	0.15
159	002645	华宏科技	18,640	512,786.40	0.15
160	002297	博云新材	17,600	510,224.00	0.15
161	601328	交通银行	77,400	497,682.00	0.14
162	300456	赛微电子	11,500	488,405.00	0.14
163	300843	胜蓝股份	3,100	484,375.00	0.14
164	301039	中集车辆	68,700	484,335.00	0.14
165	300408	三环集团	2,900	484,010.00	0.14
166	300136	信维通信	4,000	477,000.00	0.14
167	600105	永鼎股份	7,000	472,360.00	0.13
168	600028	中国石化	105,400	470,084.00	0.13
169	300058	蓝色光标	34,100	469,216.00	0.13
170	002998	优彩资源	72,000	468,720.00	0.13
171	601601	中国太保	16,400	467,728.00	0.13
172	000600	建投能源	53,300	466,375.00	0.13
173	301397	溯联股份	14,400	465,984.00	0.13
174	605318	法狮龙	4,100	462,726.00	0.13
175	000733	振华科技	8,100	458,784.00	0.13
176	688639	华恒生物	27,800	448,692.00	0.13
177	600590	泰豪科技	43,700	441,370.00	0.13
178	001203	大中矿业	14,700	440,265.00	0.13
179	603217	元利科技	19,500	437,385.00	0.12
180	603897	长城科技	13,400	434,964.00	0.12
181	688221	前沿生物	19,400	434,560.00	0.12
182	002594	比亚迪	5,386	429,264.20	0.12
183	601628	中国人寿	12,100	427,735.00	0.12
184	600547	山东黄金	18,400	424,856.00	0.12
185	002338	奥普光电	7,400	423,280.00	0.12
186	003020	立方制药	28,560	422,973.60	0.12
187	300432	富临精工	20,800	417,872.00	0.12
188	300839	博汇股份	35,500	415,705.00	0.12

189	301081	严牌股份	30,300	414,504.00	0.12
190	603296	华勤技术	5,580	414,426.60	0.12
191	600919	江苏银行	38,200	411,796.00	0.12
192	000783	长江证券	40,200	391,950.00	0.11
193	002979	雷赛智能	7,000	390,460.00	0.11
194	603798	康普顿	28,400	388,512.00	0.11
195	300458	全志科技	9,800	386,708.00	0.11
196	600460	士兰微	7,000	382,620.00	0.11
197	301316	慧博云通	9,700	381,986.00	0.11
198	000977	浪潮信息	5,400	378,000.00	0.11
199	002379	宏桥控股	25,300	373,681.00	0.11
200	300063	天龙集团	43,000	373,240.00	0.11
201	688008	澜起科技	1,200	371,880.00	0.11
202	300277	汽轮科技	24,500	368,480.00	0.10
203	002947	恒铭达	4,700	357,435.00	0.10
204	002708	光洋股份	27,000	356,130.00	0.10
205	000425	徐工机械	43,600	352,724.00	0.10
206	300864	南大环境	18,200	349,076.00	0.10
207	600690	海尔智家	16,900	344,929.00	0.10
208	301003	江苏博云	6,400	342,400.00	0.10
209	603306	华懋科技	3,300	342,177.00	0.10
210	300590	移为通信	23,600	338,660.00	0.10
211	002064	华峰化学	35,200	334,048.00	0.10
212	603067	振华股份	7,200	333,288.00	0.09
213	002396	星网锐捷	17,280	331,257.60	0.09
214	002028	思源电气	1,900	328,700.00	0.09
215	601088	中国神华	8,400	327,936.00	0.09
216	002975	博杰股份	2,300	326,600.00	0.09
217	002943	宇晶股份	7,350	325,090.50	0.09
218	300154	瑞凌股份	43,100	324,112.00	0.09
219	301127	武汉天源	15,600	323,232.00	0.09

220	000901	航天科技	18,100	321,999.00	0.09
221	600900	长江电力	12,151	321,636.97	0.09
222	003018	金富科技	4,200	320,166.00	0.09
223	000338	潍柴动力	11,600	316,100.00	0.09
224	000565	渝三峡 A	55,300	314,104.00	0.09
225	600251	冠农股份	36,300	313,632.00	0.09
226	002918	蒙娜丽莎	31,200	313,560.00	0.09
227	300033	同花顺	1,300	313,300.00	0.09
228	601127	赛力斯	5,100	312,375.00	0.09
229	688148	芳源股份	36,000	308,880.00	0.09
230	300623	捷捷微电	6,800	305,932.00	0.09
231	002990	盛视科技	3,800	300,200.00	0.09
232	601231	环旭电子	9,200	298,080.00	0.08
233	688301	奕瑞科技	2,400	297,600.00	0.08
234	601658	邮储银行	59,800	294,814.00	0.08
235	301056	森赫股份	26,300	294,560.00	0.08
236	301219	腾远钴业	5,240	287,152.00	0.08
237	300602	飞荣达	5,600	286,720.00	0.08
238	002859	洁美科技	2,600	284,726.00	0.08
239	002025	航天电器	3,700	282,014.00	0.08
240	688025	杰普特	600	282,000.00	0.08
241	688002	睿创微纳	1,800	278,442.00	0.08
242	300254	仟源医药	34,200	273,942.00	0.08
243	300017	网宿科技	21,000	273,210.00	0.08
244	688010	福光股份	5,600	272,328.00	0.08
245	002236	大华股份	16,500	272,085.00	0.08
246	002402	和而泰	10,500	271,215.00	0.08
247	300442	润泽科技	3,200	265,824.00	0.08
248	300124	汇川技术	4,000	265,320.00	0.08
249	600276	恒瑞医药	5,030	261,761.20	0.07
250	300286	安科瑞	10,800	260,820.00	0.07

251	600482	中国动力	7,900	259,120.00	0.07
252	300666	江丰电子	700	258,020.00	0.07
253	688361	中科飞测	600	258,000.00	0.07
254	300279	和晶科技	42,500	257,125.00	0.07
255	002582	好想你	30,100	254,345.00	0.07
256	002841	视源股份	7,300	252,069.00	0.07
257	002352	顺丰控股	7,900	246,954.00	0.07
258	603920	世运电路	5,100	245,004.00	0.07
259	300239	东宝生物	45,600	243,048.00	0.07
260	605123	派克新材	2,500	242,525.00	0.07
261	688523	航天环宇	4,600	241,040.00	0.07
262	301529	福赛科技	2,500	240,900.00	0.07
263	300438	鹏辉能源	2,900	240,265.00	0.07
264	300881	盛德鑫泰	6,300	235,935.00	0.07
265	600903	贵州燃气	35,500	235,720.00	0.07
266	002283	天润工业	23,900	230,635.00	0.07
267	301666	大普微	497	230,275.01	0.07
268	600299	安迪苏	29,200	229,220.00	0.07
269	688571	杭华股份	26,000	227,500.00	0.06
270	000923	河钢资源	18,200	225,862.00	0.06
271	688668	鼎通科技	600	223,980.00	0.06
272	600941	中国移动	2,600	223,938.00	0.06
273	600742	富维股份	30,400	220,096.00	0.06
274	601606	长城军工	8,000	219,920.00	0.06
275	002788	鹭燕医药	21,900	219,657.00	0.06
276	301021	英诺激光	1,800	219,420.00	0.06
277	688536	思瑞浦	600	218,454.00	0.06
278	300661	圣邦股份	1,500	215,220.00	0.06
279	002120	韵达股份	33,600	213,696.00	0.06
280	300473	德尔股份	7,000	212,800.00	0.06
281	688503	聚和材料	1,600	212,320.00	0.06

282	300775	三角防务	9,600	211,584.00	0.06
283	688593	新相微	5,400	210,168.00	0.06
284	002498	汉缆股份	30,300	206,646.00	0.06
285	603186	华正新材	900	202,770.00	0.06
286	600502	安徽建工	46,000	200,100.00	0.06
287	601995	中金公司	5,500	198,825.00	0.06
288	603156	养元饮品	4,000	196,280.00	0.06
289	300752	隆利科技	14,500	195,315.00	0.06
290	002241	歌尔股份	8,400	189,252.00	0.05
291	300979	华利集团	6,300	187,425.00	0.05
292	300139	晓程科技	5,100	186,405.00	0.05
293	300109	新开源	11,600	186,180.00	0.05
294	600150	中国船舶	5,500	185,845.00	0.05
295	300919	中伟新材	4,200	183,750.00	0.05
296	300342	天银机电	3,900	183,300.00	0.05
297	301222	浙江恒威	6,100	182,756.00	0.05
298	601579	会稽山	12,400	182,156.00	0.05
299	605138	盛泰集团	32,800	181,056.00	0.05
300	600219	南山铝业	45,200	180,348.00	0.05
301	002271	东方雨虹	15,100	179,237.00	0.05
302	301360	荣旗科技	2,600	178,074.00	0.05
303	300461	田中精机	4,700	174,088.00	0.05
304	300401	花园生物	7,800	170,742.00	0.05
305	300584	海辰药业	4,700	170,281.00	0.05
306	000100	TCL科技	28,900	168,198.00	0.05
307	301122	采纳股份	5,700	167,637.00	0.05
308	300592	华凯易佰	9,200	162,840.00	0.05
309	000576	甘化科工	24,600	161,622.00	0.05
310	300335	迪森股份	32,900	160,223.00	0.05
311	688400	凌云光	2,400	158,880.00	0.05
312	001248	华润新能源	15,419	155,886.09	0.04

313	600362	江西铜业	3,600	155,880.00	0.04
314	002259	升达林业	41,100	155,769.00	0.04
315	002922	伊戈尔	4,600	150,880.00	0.04
316	300248	新开普	19,500	150,345.00	0.04
317	300628	亿联网络	4,400	148,808.00	0.04
318	600346	恒力石化	8,400	148,764.00	0.04
319	603115	海星股份	1,200	146,964.00	0.04
320	688252	天德钰	6,021	144,504.00	0.04
321	603933	睿能科技	6,400	144,320.00	0.04
322	688781	视涯科技	3,417	144,060.72	0.04
323	688586	江航装备	12,005	140,338.45	0.04
324	000531	穗恒运 A	23,400	140,166.00	0.04
325	605499	东鹏饮料	1,100	135,773.00	0.04
326	300395	菲利华	1,000	133,730.00	0.04
327	002050	三花智控	3,000	131,490.00	0.04
328	300774	倍杰特	12,200	131,150.00	0.04
329	603124	江南新材	700	130,886.00	0.04
330	002134	天津普林	4,300	130,806.00	0.04
331	300004	南风股份	12,900	130,290.00	0.04
332	603739	蔚蓝生物	11,300	130,289.00	0.04
333	603032	德新科技	4,800	129,120.00	0.04
334	300049	福瑞医科	3,300	128,304.00	0.04
335	601061	中信金属	11,900	128,163.00	0.04
336	600392	盛和资源	4,300	128,011.00	0.04
337	688018	乐鑫科技	1,000	127,920.00	0.04
338	688275	万润新能	1,000	127,550.00	0.04
339	001376	百通能源	12,100	125,840.00	0.04
340	600879	航天电子	5,900	125,611.00	0.04
341	601108	财通证券	14,500	125,425.00	0.04
342	688808	联讯仪器	79	125,162.07	0.04
343	002202	金风科技	5,200	124,280.00	0.04

344	300703	创源股份	9,700	123,869.00	0.04
345	002545	东方铁塔	7,600	123,272.00	0.04
346	002970	锐明技术	2,300	122,889.00	0.04
347	601168	西部矿业	4,500	122,130.00	0.03
348	300942	易瑞生物	21,100	121,958.00	0.03
349	002228	合兴包装	41,100	120,834.00	0.03
350	688001	华兴源创	1,400	119,980.00	0.03
351	002602	世纪华通	8,200	115,620.00	0.03
352	688195	腾景科技	600	115,548.00	0.03
353	002655	共达电声	2,500	115,000.00	0.03
354	300115	长盈精密	4,100	114,554.00	0.03
355	000786	北新建材	6,200	112,158.00	0.03
356	600026	中远海能	6,200	111,228.00	0.03
357	000858	五 粮 液	1,500	111,000.00	0.03
358	300920	润阳科技	3,200	110,560.00	0.03
359	002245	蔚蓝锂芯	5,900	110,389.00	0.03
360	300952	恒辉安防	6,300	109,620.00	0.03
361	603680	今创集团	11,100	108,891.00	0.03
362	603309	维力医疗	9,700	108,834.00	0.03
363	000651	格力电器	2,900	108,750.00	0.03
364	000034	神州数码	3,900	108,225.00	0.03
365	000533	顺钠股份	11,300	107,463.00	0.03
366	600031	三一重工	6,200	107,136.00	0.03
367	002166	莱茵生物	16,800	105,504.00	0.03
368	301329	信音电子	4,300	104,447.00	0.03
369	001360	南矿集团	5,900	104,371.00	0.03
370	300715	凯伦股份	6,300	103,698.00	0.03
371	000021	深科技	1,600	102,832.00	0.03
372	300191	潜能恒信	3,700	102,305.00	0.03
373	002532	天山铝业	9,500	101,935.00	0.03
374	301025	读客文化	13,100	101,656.00	0.03

375	688720	艾森股份	1,000	101,000.00	0.03
376	301662	宏工科技	995	100,813.40	0.03
377	000810	创维数字	7,600	100,700.00	0.03
378	300487	蓝晓科技	1,700	100,045.00	0.03
379	301396	宏景科技	300	99,480.00	0.03
380	002412	汉森制药	17,900	98,450.00	0.03
381	002256	兆新股份	27,100	98,373.00	0.03
382	600790	轻纺城	29,600	96,792.00	0.03
383	003035	南网能源	16,400	95,448.00	0.03
384	688518	联赢激光	3,000	92,700.00	0.03
385	002380	科远智慧	2,700	92,286.00	0.03
386	601101	昊华能源	8,700	91,872.00	0.03
387	002057	中钢天源	7,200	89,496.00	0.03
388	601916	浙商银行	33,600	88,368.00	0.03
389	300275	梅安森	11,000	88,330.00	0.03
390	301196	唯科科技	700	87,794.00	0.03
391	600183	生益科技	500	86,700.00	0.02
391	000975	山金国际	5,100	86,700.00	0.02
392	603160	汇顶科技	1,400	86,394.00	0.02
393	603696	安记食品	7,500	86,250.00	0.02
394	601918	新集能源	10,000	85,900.00	0.02
395	301057	汇隆新材	3,700	85,100.00	0.02
396	002756	永兴材料	1,500	84,960.00	0.02
397	003019	宸展光电	2,600	84,630.00	0.02
398	002960	青鸟智控	9,800	83,006.00	0.02
399	600841	动力新科	13,500	82,350.00	0.02
400	002540	亚太科技	17,200	80,324.00	0.02
401	603889	新澳股份	15,600	79,716.00	0.02
402	688183	生益电子	600	79,440.00	0.02
403	002404	嘉欣丝绸	13,600	77,792.00	0.02
404	000623	吉林敖东	4,300	76,239.00	0.02

405	688697	纽威数控	5,600	76,104.00	0.02
406	600361	创新新材	21,100	75,960.00	0.02
407	603126	中材节能	11,900	74,970.00	0.02
408	600583	海油工程	14,900	74,947.00	0.02
409	603505	金石资源	3,700	74,555.00	0.02
410	600796	钱江生化	16,000	74,240.00	0.02
411	002179	中航光电	1,600	73,920.00	0.02
412	600660	福耀玻璃	1,449	73,087.56	0.02
413	300664	鹏鹞环保	17,200	72,928.00	0.02
414	000962	东方钨业	800	72,480.00	0.02
415	600489	中金黄金	4,000	72,200.00	0.02
416	600232	金鹰股份	11,400	71,820.00	0.02
416	000596	古井贡酒	900	71,820.00	0.02
417	000060	中金岭南	9,400	71,158.00	0.02
418	300354	东华测试	2,100	71,148.00	0.02
419	002706	良信股份	6,500	70,915.00	0.02
420	001313	粤海饲料	10,000	70,900.00	0.02
421	688818	电科蓝天	1,006	70,560.84	0.02
422	001965	招商公路	7,600	69,616.00	0.02
423	603871	嘉友国际	6,800	69,428.00	0.02
424	300215	电科院	10,300	67,877.00	0.02
425	002409	雅克科技	300	67,350.00	0.02
426	000166	申万宏源	15,200	66,880.00	0.02
427	002203	海亮股份	2,900	66,265.00	0.02
428	688820	盛合晶微	468	66,217.32	0.02
429	000036	华联控股	15,100	65,987.00	0.02
430	002824	和胜股份	1,900	65,702.00	0.02
431	002476	新叶股份	13,400	65,124.00	0.02
432	603283	赛腾股份	800	64,784.00	0.02
433	300654	世纪天鸿	6,600	64,152.00	0.02
434	300199	翰宇药业	2,900	64,032.00	0.02

435	300908	仲景食品	2,900	63,916.00	0.02
436	002294	信立泰	2,000	63,780.00	0.02
437	300567	精测电子	200	63,520.00	0.02
438	300990	同飞股份	600	63,042.00	0.02
439	601233	桐昆股份	2,900	62,785.00	0.02
440	300855	图南股份	2,000	62,520.00	0.02
441	688510	航亚科技	2,600	62,088.00	0.02
442	301367	瑞迈特	1,600	61,856.00	0.02
443	600727	鲁北化工	9,200	61,824.00	0.02
444	600356	恒丰纸业	8,300	61,503.00	0.02
445	603320	迪贝电气	3,500	61,075.00	0.02
446	002395	双象股份	5,100	60,996.00	0.02
447	600801	华新建材	3,900	60,840.00	0.02
448	301358	湖南裕能	800	60,696.00	0.02
449	000725	京东方 A	6,900	59,892.00	0.02
450	001208	华菱线缆	4,200	59,598.00	0.02
451	300606	金太阳	1,400	59,584.00	0.02
452	688797	臻宝科技	127	59,521.09	0.02
453	002460	赣锋锂业	900	58,860.00	0.02
454	002130	沃尔核材	3,100	58,776.00	0.02
455	600267	海正药业	5,700	57,627.00	0.02
456	300491	通合科技	1,500	57,285.00	0.02
457	000933	神火股份	2,700	57,240.00	0.02
458	600348	华阳股份	7,400	56,610.00	0.02
459	300987	川网传媒	4,600	56,580.00	0.02
460	301283	聚胶股份	2,300	56,304.00	0.02
461	002837	英维克	700	55,692.00	0.02
462	301682	宏明电子	346	55,380.76	0.02
463	000683	博源化工	9,600	55,296.00	0.02
464	600499	科达制造	4,000	55,200.00	0.02
465	301016	雷尔伟	3,900	54,483.00	0.02

466	600000	浦发银行	6,300	54,243.00	0.02
467	301305	朗坤科技	1,900	54,188.00	0.02
468	300953	震裕科技	400	53,480.00	0.02
469	002250	联化科技	3,900	53,313.00	0.02
470	688580	伟思医疗	1,000	53,270.00	0.02
471	003816	中国广核	13,600	53,176.00	0.02
472	600570	恒生电子	2,500	52,975.00	0.02
473	300236	上海新阳	400	52,600.00	0.01
474	002266	浙富控股	10,200	51,612.00	0.01
475	601865	福莱特	4,900	51,499.00	0.01
476	000570	苏常柴 A	10,900	50,903.00	0.01
477	688712	北芯生命	1,408	50,575.36	0.01
478	300339	润和软件	1,300	50,063.00	0.01
479	601377	兴业证券	8,100	48,924.00	0.01
480	001872	招商港口	2,500	48,575.00	0.01
481	002493	荣盛石化	4,500	48,375.00	0.01
482	300413	芒果超媒	3,200	46,816.00	0.01
483	001270	铖昌科技	300	46,797.00	0.01
484	001399	惠科股份	1,687	46,780.51	0.01
485	300916	朗特智能	2,000	46,740.00	0.01
486	600926	杭州银行	3,200	46,240.00	0.01
487	301060	兰卫医学	5,600	45,752.00	0.01
488	000981	山子高科	15,500	44,640.00	0.01
489	000950	重药控股	8,900	44,589.00	0.01
490	600970	中材国际	6,200	44,206.00	0.01
491	688579	地纬智能	5,800	44,022.00	0.01
492	002683	广东宏大	1,500	43,935.00	0.01
493	600886	国投电力	3,300	43,923.00	0.01
494	300016	北陆药业	5,700	43,719.00	0.01
495	600391	航发科技	1,300	43,485.00	0.01
496	688390	固德威	400	43,404.00	0.01

497	300447	全信股份	2,800	41,804.00	0.01
498	002942	新农股份	2,900	41,557.00	0.01
499	000921	海信家电	1,500	40,980.00	0.01
500	301230	泓博医药	1,100	40,524.00	0.01
501	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
502	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
503	688785	恒运昌	85	39,367.75	0.01
504	301190	善水科技	2,400	38,472.00	0.01
505	301195	北路智控	1,400	37,940.00	0.01
506	688508	芯朋微	400	37,184.00	0.01
507	603685	晨丰科技	1,300	37,050.00	0.01
508	000419	通程控股	8,200	36,982.00	0.01
509	300922	天秦装备	2,300	34,845.00	0.01
510	300476	胜宏科技	100	34,643.00	0.01
511	001257	盛龙股份	1,436	29,782.64	0.01
512	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
513	603459	红板科技	210	17,707.20	0.01
513	301696	三瑞智能	204	17,707.20	0.01
514	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
515	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
516	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
517	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
518	301599	理奇智能	394	12,793.18	0.00
519	001365	天海电子	333	10,426.23	0.00
520	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
521	301683	慧谷新材	79	9,619.83	0.00
522	001393	维通利	235	9,162.65	0.00
523	688816	易思维	139	7,936.90	0.00
524	001237	惠康科技	135	7,929.90	0.00
525	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
526	601112	振石股份	319	5,611.21	0.00

527	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
528	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
529	001312	福恩股份	118	1,980.04	0.00
530	603293	埃泰克	58	1,967.94	0.00
531	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
532	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	300308	中际旭创	12,988,390.00	3.98
2	300857	协创数据	12,628,268.60	3.87
3	300750	宁德时代	11,662,972.00	3.57
4	000657	中钨高新	11,152,242.00	3.42
5	603986	兆易创新	11,117,155.00	3.41
6	301308	江波龙	10,995,953.00	3.37
7	002008	大族激光	10,815,144.00	3.31
8	300274	阳光电源	10,306,346.00	3.16
9	002558	巨人网络	9,886,714.00	3.03
10	000426	兴业银锡	9,693,276.00	2.97
11	002281	光迅科技	9,587,803.00	2.94
12	688256	寒武纪	9,577,626.00	2.93
13	002851	麦格米特	9,544,816.00	2.92
14	300502	新易盛	9,441,388.00	2.89
15	300450	先导智能	9,224,947.00	2.83
16	603588	高能环境	9,211,883.00	2.82
17	688766	普冉股份	9,165,337.69	2.81
18	600150	中国船舶	9,137,575.20	2.80

19	300014	亿纬锂能	8,756,438.22	2.68
20	601138	工业富联	8,703,228.00	2.67
21	600030	中信证券	8,578,322.00	2.63
22	603993	洛阳钼业	8,080,829.00	2.48
23	001309	德明利	7,964,743.00	2.44
24	002475	立讯精密	7,915,902.00	2.42
25	601869	长飞光纤	7,864,919.00	2.41
26	301358	湖南裕能	7,768,918.00	2.38
27	603920	世运电路	7,756,710.00	2.38
28	688525	佰维存储	7,504,492.94	2.30
29	688041	海光信息	7,400,800.45	2.27
30	600183	生益科技	7,294,697.00	2.23
31	002415	海康威视	7,165,673.00	2.19
32	002222	福晶科技	6,976,778.00	2.14
33	300604	长川科技	6,880,785.00	2.11
34	601872	招商轮船	6,833,229.00	2.09
35	002384	东山精密	6,739,384.00	2.06
36	688981	中芯国际	6,692,868.37	2.05
37	000333	美的集团	6,659,747.00	2.04

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

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	002008	大族激光	15,434,445.00	4.73
2	300750	宁德时代	12,762,548.00	3.91
3	000657	中钨高新	12,377,553.20	3.79
4	300274	阳光电源	11,978,103.00	3.67

5	300857	协创数据	11,343,063.40	3.47
6	301308	江波龙	11,147,469.00	3.41
7	002475	立讯精密	10,788,375.00	3.30
8	603986	兆易创新	10,614,231.00	3.25
9	300014	亿纬锂能	10,351,886.60	3.17
10	000426	兴业银锡	10,305,426.00	3.16
11	601899	紫金矿业	9,675,409.00	2.96
12	002281	光迅科技	9,669,126.00	2.96
13	300308	中际旭创	9,499,623.00	2.91
14	601869	长飞光纤	9,429,583.35	2.89
15	600150	中国船舶	9,402,214.00	2.88
16	002851	麦格米特	9,209,844.00	2.82
17	300502	新易盛	9,200,754.00	2.82
18	002222	福晶科技	8,909,176.00	2.73
19	601872	招商轮船	8,867,798.00	2.72
20	603993	洛阳钼业	8,857,444.00	2.71
21	603920	世运电路	8,834,096.00	2.71
22	688766	普冉股份	8,709,800.67	2.67
23	002558	巨人网络	8,700,724.00	2.66
24	688256	寒武纪	8,574,152.00	2.63
25	603259	药明康德	8,526,112.00	2.61
26	600276	恒瑞医药	8,316,624.00	2.55
27	601088	中国神华	8,285,360.00	2.54
28	600549	厦门钨业	8,135,405.00	2.49
29	600026	中远海能	8,066,483.54	2.47
30	000333	美的集团	8,036,206.40	2.46
31	600309	万华化学	8,004,990.50	2.45
32	600183	生益科技	7,835,676.00	2.40
33	688041	海光信息	7,689,039.80	2.36
34	000063	中兴通讯	7,667,679.00	2.35
35	601138	工业富联	7,659,294.00	2.35

36	301358	湖南裕能	7,646,563.00	2.34
37	002402	和而泰	7,596,233.00	2.33
38	300450	先导智能	7,594,108.00	2.33
39	600487	亨通光电	7,490,450.00	2.29
40	603256	宏和科技	7,282,939.00	2.23
41	688525	佰维存储	7,036,995.29	2.16
42	600030	中信证券	6,870,062.00	2.10
43	300604	长川科技	6,840,863.00	2.10
44	002916	深南电路	6,813,349.00	2.09
45	688002	睿创微纳	6,797,662.80	2.08
46	000792	盐湖股份	6,763,091.00	2.07
47	603588	高能环境	6,655,488.00	2.04
48	600519	贵州茅台	6,642,327.00	2.03
49	000651	格力电器	6,573,613.00	2.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,034,206,162.88
卖出股票收入（成交）总额	2,067,588,579.89

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	17,841,002.71	5.08
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	17,841,002.71	5.08

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	84,000	8,454,448.11	2.41
2	019785	25国债13	52,000	5,265,652.49	1.50
3	019835	26国债09	25,000	2,504,114.38	0.71
4	019792	25国债19	16,000	1,616,787.73	0.46

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	1,428,375.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,428,375.40

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。

58 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户	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	持有份额	占总份 额比例

	数 (户)			比例		
博道 启航 混合A	5,336	15,285.28	13,953,010.17	17.11%	67,609,265.50	82.89%
博道 启航 混合C	25,684	2,019.34	16,787,433.08	32.37%	35,077,272.16	67.63%
合计	30,871	4,322.08	30,740,443.25	23.04%	102,686,537.66	76.96%

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	97.58%

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	博道启航混合A	773,286.38	0.95%
	博道启航混合C	2,441.48	0.00%
	合计	775,727.86	0.58%

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	博道启航混合A	0~10
	博道启航混合C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	博道启航混合A	0
	博道启航混合C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道启航混合A	博道启航混合C
基金合同生效日(2018年08月10日)基金份额总额	339,042,191.43	385,666,935.23
本报告期期初基金份额总额	81,264,943.56	68,657,977.13
本报告期基金总申购份额	24,790,772.00	46,991,792.12
减：本报告期基金总赎回份额	24,493,439.89	63,785,064.01
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	81,562,275.67	51,864,705.24

注：

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

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。自本基金基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及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	
国泰海通证券	2	4,099,957,093.25	100.00%	1,787,645.68	100.00%	-

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
国泰海通证券	22,551,407.40	100.00%	2,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：

1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；

- 2、基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：
- （1）经营行为稳健规范，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	博道启航混合型证券投资基金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、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-04
4	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、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-19
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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2026-03-31

	告		
7	博道启航混合型证券投资基金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、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-01
9	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人承销证券的公告	上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-09
10	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
11	博道启航混合型证券投资基金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
12	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、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
13	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
14	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、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-21
15	博道基金管理有限公司关于博道启航混合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	2026-05-23
16	博道启航混合型证券投资基金（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	2026-05-25
17	博道启航混合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	2026-05-25
18	博道基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证券报、	2026-06-03

	提醒客户及时提供或更新身份信息资料的公告	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	
19	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	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	2026-06-27
20	博道启航混合型证券投资基金基金合同	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-27

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

根据本基金管理人于2026年6月27日发布的《博道基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，经与基金托管人协商一致，自2026年7月27日起调整本基金的业绩比较基准，具体参见基金管理人在规定媒介上发布的公告。

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

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

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

博道基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日