

博道衍和债券型证券投资基金

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04月22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	6
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	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	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的真实、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	18
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	64
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	64
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	64
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	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12 投资组合报告附注	65
§8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	67
§9 开放式基金份额变动	67
§10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
10.4 基金投资策略的改变	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	68
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	69
10.8 其他重大事件	70
§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	博道衍和债券型证券投资基金	
基金简称	博道衍和债券	
基金主代码	027004	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026年04月22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	1,717,370,715.22份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道衍和债券A	博道衍和债券C
下属分级基金的交易代码	027004	027005
报告期末下属分级基金的份额总额	130,903,782.37份	1,586,466,932.85份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用稳健的资产配置策略，结合各大类资产的市场表现和波动率水平、风险预算等因素在基金合同约定的比例范围内确定固定收益类资产、权益类资产和现金等大类资产的配置比例，力争通过资产配置降低组合波动性，提高基金资产风险调整后收益。本基金债券投资综合运用久期管理策略、期限结构策略、个券选择策略、息差策略、可转换债券和可交换债券投资策略、信用债投资策略等多种策略，力争获取债券资产长期稳健的收益。本基金在股票投资方面，首先，综合考虑股票的估值、盈利情况、波动特性等因素，筛选出满足一定基本面要求的股票，构建备选股票池。然后，综合考虑股票的估值、股息、波动率、成长、盈利能力、营运质量、事件性因素、价量特征等因子，对股票进行综合评价后，挑选符合一定标准

	的股票用于构建股票组合。本基金管理人会持续研究市场的状态以及市场变化，并对模型和模型所采用的因子做出适当更新或调整。本基金可投资于全市场的股票ETF以及本基金管理人管理的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金。本基金的基金投资策略采用定量分析和定性分析相结合的方式，根据本基金的投资目标和投资策略，优选符合策略配置需求的基金进行投资。本基金的国债期货投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率×85%+中证红利低波动指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为债券型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

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	叶文璜	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	《中国证券报》
----------------	---------

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04月22日（基金合同生效日）-2026年06月30日)	
	博道衍和债券A	博道衍和债券C
本期已实现收益	195,400.90	1,769,604.70
本期利润	-876,123.50	-11,213,783.39
加权平均基金份额本期利润	-0.0067	-0.0071
本期加权平均净值利润率	-0.67%	-0.71%
本期基金份额净值增长率	-0.67%	-0.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
	博道衍和债券A	博道衍和债券C
期末可供分配利润	-876,123.50	-11,213,783.39
期末可供分配基金份额利润	-0.0067	-0.0071
期末基金资产净值	130,027,658.87	1,575,253,149.46
期末基金份额净值	0.9933	0.9929
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
	博道衍和债券A	博道衍和债券C
基金份额累计净值增长率	-0.67%	-0.71%

注：

- 1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；
- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；
- 3、本基金合同生效日为2026年04月22日，基金合同生效日至本报告期期末，本基金运作时间未满半年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博道衍和债券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
自基金合同 生效起至今	-0.67%	0.19%	-1.87%	0.14%	1.20%	0.05%

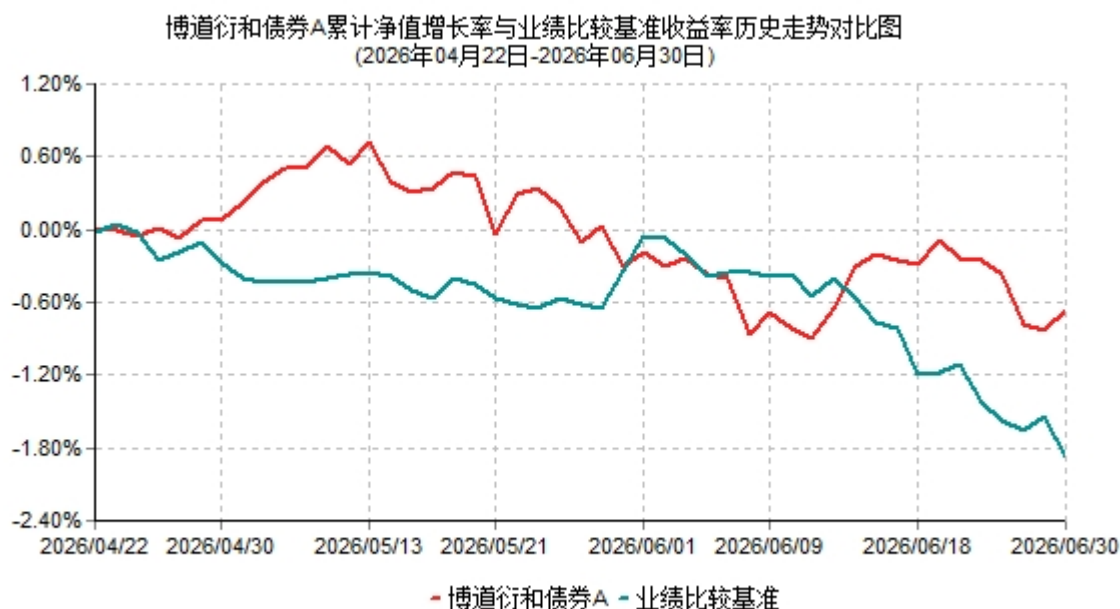
注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

博道衍和债券C

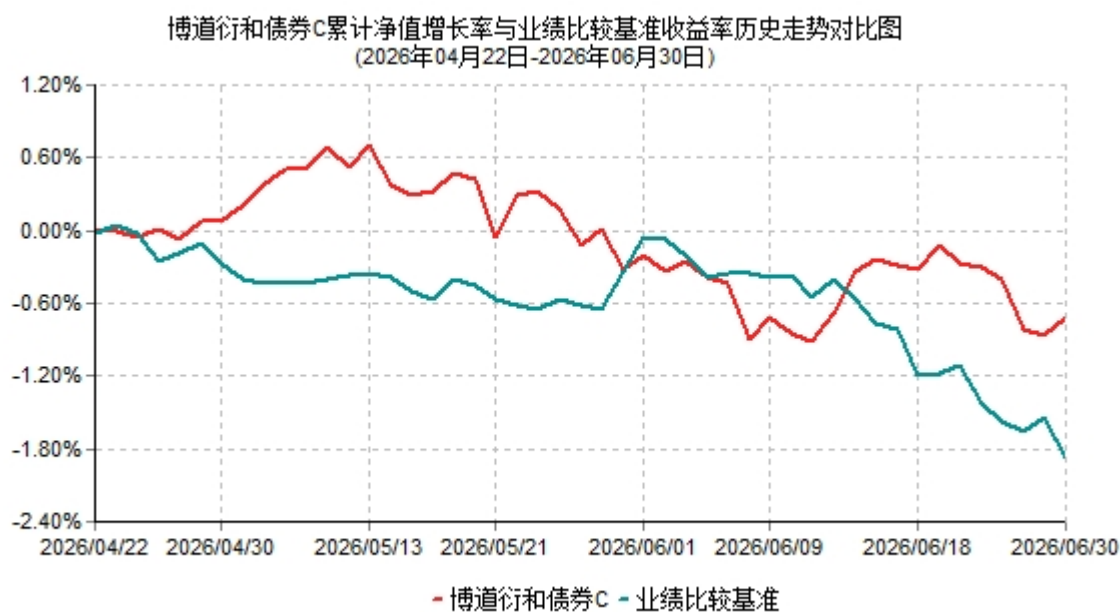
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
自基金合同 生效起至今	-0.71%	0.19%	-1.87%	0.14%	1.16%	0.05%

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。

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：本基金基金合同生效日为2026年4月22日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。基金合同生效日至报告期期末，本基金尚处于建仓期，且运作时间未满一年。



注：本基金基金合同生效日为2026年4月22日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。基金合同生效日至报告期期末，本基金尚处于建仓期，且运作时间未满一年。

§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		
杨梦	博道中证500增强、博道沪深300增强、博道远航混合、博道伍佰智航、博道成长智航股票、博道中证1000指数增强、博道大盘成长股票、博道沪深300指数量化增强、博道中证A500指数增强、博道中证800指数增强、博道上证科创板综合指数增强、博道中证全指指数增强、博道星航混合、博道衍和债券的基金经理、量化投资总监兼量化投资部总经理	2026-04-22	-	15年	杨梦女士，中国籍，经济学硕士。2011年7月至2014年6月担任农银汇理基金管理有限公司量化研究员，2014年6月至2014年11月担任华泰资产管理有限公司量化研究员，2014年11月至2017年7月担任上海博道投资管理有限公司投资经理助理、投资经理。2017年8月加入博道基金管理有限公司。具有基金从业资格。
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	2026-04-22	-	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

	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				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。
马少杰	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合、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助理	2026-04-22	-	6年	马少杰先生，中国籍，经济学硕士。2020年4月至2022年9月担任中国国际金融股份有限公司投资经理助理，2022年9月至2024年9月担任东方证券股份有限公司交易员，2024年9月至2026年3月担任鹏华基金管理有限公司基金经理助理。2026年3月加入博道基金管理有限公司。具有基金从业资格。

注：

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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。国债收益率整体下行，2年期国债利率下行11BP到1.25%，10年期国债利率下行12BP到1.73%，中证综合债指数上涨2.02%。权益市场方面，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%，而恒生指数下跌10.73%，恒生科技指数下跌18.92%。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，本基金主要配置于红利低波股票增强模型，及以利率债为主的债券投资策略，目标是借助低波股票投资思路改善组合权益仓位的风险收益特征，利用股债风险对冲来平衡产品的风险收益比。

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

展望下半年，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；对于量化类产品，需重点关注三四季度动量反转的可能性并做好防范应对。从资产配置和投资策略角度而言，在波动率提高的环境下，股债均衡的“固收+”产品的配置价值值得持续关注。

本基金将继续坚持既定策略，秉持勤勉尽责，力争为投资者获得有竞争力的绝对收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的投资研究相关人员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司估值委员会审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，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衍和债券型证券投资基金（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：博道衍和债券型证券投资基金

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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	581,567,215.57
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,125,097,967.47
其中：股票投资		252,156,118.58
基金投资		-

债券投资		872,941,848.89
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		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		1,706,665,183.04
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30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		-
应付管理人报酬		842,774.58
应付托管费		210,693.64
应付销售服务费		259,506.02
应付投资顾问费		-
应交税费		13,156.97
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.5	58,243.50
负债合计		1,384,374.71
净资产：		

实收基金	6.4.7.6	1,717,370,715.22
未分配利润	6.4.7.7	-12,089,906.89
净资产合计		1,705,280,808.33
负债和净资产总计		1,706,665,183.04

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：博道衍和债券型证券投资基金

本报告期：2026年04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年04月22日（基金合同 生效日）至2026年06月30 日
一、营业总收入		-8,970,692.54
1.利息收入		1,726,779.46
其中：存款利息收入	6.4.7.8	30,520.57
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		1,696,258.89
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,357,440.49
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-1,154,440.90
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.10	2,412,757.16
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	2,099,124.23
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	-14,054,912.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-
减：二、营业总支出		3,119,214.35
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,945,856.22
2.托管费	6.4.10.2.2	486,464.04
3.销售服务费		599,170.33
4.投资顾问费		-
5.利息支出		40,698.97
其中：卖出回购金融资产支出		40,698.97
6.信用减值损失		-
7.税金及附加		2,581.79
8.其他费用	6.4.7.16	44,443.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,089,906.89
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,089,906.89
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-12,089,906.89

6.3 净资产变动表

会计主体：博道衍和债券型证券投资基金

本报告期：2026年04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026年04月22日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	1,717,370,715.22	-	1,717,370,715.22

三、本期增减变动 额（减少以“-”号 填列）	-	-12,089,906.89	-12,089,906.89
（一）、综合收益 总额	-	-12,089,906.89	-12,089,906.89
（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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回 款	-	-	-
（三）、本期向基 金份额持有人分配 利润产生的净资产 变动（净资产减少 以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资 产	1,717,370,715.22	-12,089,906.89	1,705,280,808.33

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

博道衍和债券型证券投资基金（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[2026]439号《关于准予博道衍和债券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《博道衍和债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,717,036,932.79元，业经容诚会计师事务所（特殊普通合伙）容诚验字[2026]200Z0089号验资报告予以验证。

经向中国证监会备案,《博道衍和债券型证券投资基金基金合同》于2026年4月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,717,370,715.22份基金份额,其中认购资金利息折合333,782.43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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《博道衍和债券型证券投资基金基金合同》和《博道衍和债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据所收取费用的差异,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用,并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额,投资人通过基金管理人认购/申购A类基金份额时不收取认购/申购费用。在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金财产中计提销售服务费并根据法律法规和基金合同的约定收取销售服务费的基金份额,称为C类基金份额;其中,对于投资者通过基金管理人认购/申购的C类基金份额所计提的销售服务费或者通过其他销售机构认购/申购且持续持有期限超过一年(即365天)的C类基金份额继续计提的销售服务费,将在投资人赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者。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《博道衍和债券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)、国债期货、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(不包含QDII基金、香港互认基金、基金中基金和其他投资范围包含基金的基金、货币市场基金),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:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,投资于股票、股票型基金、计入权益类资产的混合型基金等权益类资产及可交换债券和可转换债券(含分离交易可转债)的比例合计为基金资产的5%-20%,其中投资于境内股票资产(含境内上市且仅投资A股的ETF)的比例不低于基金资产的5%。上述计入权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一:(1)基金合同约定股票(含存托凭证)资产投资比例应不低于基金资产的60%;(2)最近四个季度定期报告披露的股票(含存托凭证)资产投资比例均不低于基金资产的60%。本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的市值不超过基金资产净值的10%。每个交易日日终在扣除国债期货

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。如法律法规或监管机构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债综合全价（总值）指数收益率 $\times 85\%$ +中证红利低波动指数收益率 $\times 15\%$ 。

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04月22日（基金合同生效日）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04月22日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2026年04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资

产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本 and 努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具

有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称"指引")，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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	3,465,164.53
等于：本金	3,464,721.31
加：应计利息	443.22
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	578,102,051.04
等于：本金	578,101,080.08
加：应计利息	970.96
减：坏账准备	-
合计	581,567,215.57

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		266,321,308.52	-	252,156,118.58	-14,165,189.94
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	122,629,932.00	696,210.96	123,390,960.96	64,818.00
	银行间市场	742,176,540.55	7,328,887.93	749,550,887.93	45,459.45

	合计	864,806,472.55	8,025,098.89	872,941,848.89	110,277.45
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,131,127,781.07	8,025,098.89	1,125,097,967.47	-14,054,912.49

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	-
应付交易费用	6,575.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	6,575.00
应付利息	-
预提费用-审计费	16,535.40
预提费用-信息披露费	24,803.10
预提费用-账户维护费	3,100.00
其他应付	7,230.00

合计	58,243.50
----	-----------

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 博道衍和债券A

金额单位：人民币元

项目 (博道衍和债券A)	本期 2026年04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	130,903,782.37	130,903,782.37
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	130,903,782.37	130,903,782.37

6.4.7.6.2 博道衍和债券C

金额单位：人民币元

项目 (博道衍和债券C)	本期 2026年04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,586,466,932.85	1,586,466,932.85
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,586,466,932.85	1,586,466,932.85

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2026年04月01日至2026年04月20日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币1,717,036,932.79元，折合为1,717,036,932.79份基金份额（其中A类基金份额130,880,211.83份，C类基金份额1,586,156,720.96份）。根据《博道衍和债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币333,782.43元，折合为333,782.43份基金份额（其中A类基金份额23,570.54份，C类基金份额310,211.89份），划入基金份额持有人账户；

4、根据《博道衍和债券型证券投资基金基金合同》、《博道衍和债券型证券投资基金招募说明书》及《博道基金管理有限公司关于博道衍和债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于2026年04月22日(基金合同生效日)至2026年07月21日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务、转换业务和定期定额投资业务自2026年07月22日起开始办理。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 博道衍和债券A

单位：人民币元

项目 (博道衍和债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	195,400.90	-1,071,524.40	-876,123.50
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	195,400.90	-1,071,524.40	-876,123.50

6.4.7.7.2 博道衍和债券C

单位：人民币元

项目 (博道衍和债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,769,604.70	-12,983,388.09	-11,213,783.39
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,769,604.70	-12,983,388.09	-11,213,783.39

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日
活期存款利息收入	23,009.41
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	7,511.16
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	30,520.57

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04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日
卖出股票成交总额	926,285,939.07
减：卖出股票成本总额	926,416,363.67
减：交易费用	1,024,016.30
买卖股票差价收入	-1,154,440.90

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04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	2,079,777.91

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	332,979.25
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,412,757.16

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04月22日（基金合同生效日）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	444,307,129.51
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	441,739,825.61
减：应计利息总额	2,222,043.99
减：交易费用	12,280.66
买卖债券差价收入	332,979.25

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04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,099,124.23
基金投资产生的股利收益	-

合计	2,099,124.23
----	--------------

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04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-14,054,912.49
——股票投资	-14,165,189.94
——债券投资	110,277.45
——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	-14,054,912.49

6.4.7.15 其他收入

无。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日
审计费用	16,535.40
信息披露费	24,803.10
汇划手续费	4.50
账户维护费-中债登	1,500.00

账户维护费-上清所	1,600.00
合计	44,443.00

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、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

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04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,945,856.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	934,046.00
应支付基金管理人的净管理费	1,011,810.22

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%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04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	486,464.04

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×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04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道衍和债券A	博道衍和债券C	合计
中国光大	-	449,858.10	449,858.10

银行股份 有限公司			
合计	-	449,858.10	449,858.10

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计。具体收取/返还方式如下：

对于投资者通过直销机构认购、申购的C类基金份额，计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额时随赎回款一并返还给投资者。本基金暂不开通基金管理人销售本基金C类基金份额。

对于投资者通过其他销售机构认购、申购的C类基金份额，持续持有期限不超过一年(即365天，下同)的基金份额计提的销售服务费逐日累计至每月月底，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。对于持续持有期限超过一年的C类基金份额继续计提的销售服务费，将在投资者赎回相应基金份额时随赎回款一并返还给投资者。

其计算公式为：日销售服务费=前一日C类基金资产净值×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

无。

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

无。

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04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大 银行股份 有限公司	3,465,164.53	23,009.41

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

无。

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光大银行，其他存款存放于中信证券华南股份有限公司，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12.93%。

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综合持仓集中度指标、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，本基金无流动性受限资产。

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1,706,663,768.86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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

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	581,567,215.57	-	-	-	-	-	581,567,215.57
交易性金融资产	199,850,109.77	51,678,835.62	423,579,641.12	71,789,920.55	126,043,341.83	252,156,118.58	1,125,097,967.47
资产总计	781,417,325.34	51,678,835.62	423,579,641.12	71,789,920.55	126,043,341.83	252,156,118.58	1,706,665,183.04
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	842,774.58	842,774.58
应付托管费	-	-	-	-	-	210,693.64	210,693.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-	259,506.02	259,506.02
应交税费	-	-	-	-	-	13,156.97	13,156.97
其他负债	-	-	-	-	-	58,243.50	58,243.50
负债总计	-	-	-	-	-	1,384,374.71	1,384,374.71
利率敏感度缺口	781,417,325.34	51,678,835.62	423,579,641.12	71,789,920.55	126,043,341.83	250,771,743.87	1,705,280,808.33

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

假设	除市场利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
	1.市场利率下降25个基点	4,037,401.75
	2.市场利率上升25个基点	-3,937,918.93

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。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于股票、股票型基金、计入权益类资产的混合型基金等权益类资产及可交换债券和可转换债券（含分离交易可转债）的比例合计为基金资产的5%-20%，其中投资于境内股票资产（含境内上市且仅投资A股的ETF）的比例不低于基金资产的5%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的保证金以后，现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	
	公允价值	占基金资产净

		值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	252,156,118.58	14.79
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	252,156,118.58	14.79

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2026年6月30日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例为14.79%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金净资产无重大影响。

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
第一层次	252,156,118.58
第二层次	872,941,848.89

第三层次	-
合计	1,125,097,967.47

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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	252,156,118.58	14.77
	其中：股票	252,156,118.58	14.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	872,941,848.89	51.15
	其中：债券	872,941,848.89	51.15
	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	581,567,215.57	34.08
8	其他各项资产	-	-
9	合计	1,706,665,183.04	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	2,574,374.60	0.15
B	采矿业	11,043,872.25	0.65
C	制造业	174,208,976.53	10.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,846,736.00	0.46
E	建筑业	3,544,117.00	0.21
F	批发和零售业	19,323,859.00	1.13
G	交通运输、仓储和邮政业	4,476,501.00	0.26
H	住宿和餐饮业	1,441,414.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,175,030.80	0.42
J	金融业	8,679,618.20	0.51
K	房地产业	103,200.00	0.01
L	租赁和商务服务业	644,635.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	6,724,069.00	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	2,339,130.20	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	63,450.00	0.00
Q	卫生和社会工作	116,720.00	0.01

R	文化、体育和娱乐业	1,850,415.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	252,156,118.58	14.79

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	002415	海康威视	181,100	6,193,620.00	0.36
2	000554	泰山石油	966,500	5,422,065.00	0.32
3	300073	当升科技	110,900	5,327,636.00	0.31
4	600590	泰豪科技	338,300	3,416,830.00	0.20
5	600469	风神股份	574,550	3,125,552.00	0.18
6	600030	中信证券	108,600	3,120,078.00	0.18
7	603680	今创集团	317,800	3,117,618.00	0.18
8	000026	飞亚达	136,200	2,933,748.00	0.17
9	300516	久之洋	83,440	2,733,494.40	0.16
10	002643	万润股份	129,700	2,717,215.00	0.16
11	600230	沧州大化	201,800	2,627,436.00	0.15
12	600219	南山铝业	657,400	2,623,026.00	0.15
13	601600	中国铝业	311,200	2,558,064.00	0.15
14	002057	中钢天源	200,200	2,488,486.00	0.15
15	301039	中集车辆	329,200	2,320,860.00	0.14
16	603126	中材节能	355,700	2,240,910.00	0.13
17	002593	日上集团	555,000	2,214,450.00	0.13
18	601798	蓝科高新	293,600	2,125,664.00	0.12
19	000969	安泰科技	84,200	2,066,268.00	0.12

20	003035	南网能源	354,300	2,062,026.00	0.12
21	000657	中钨高新	20,400	1,952,688.00	0.11
22	300425	中建环能	516,900	1,933,206.00	0.11
23	603588	高能环境	98,700	1,895,040.00	0.11
24	600391	航发科技	55,600	1,859,820.00	0.11
25	300788	中信出版	80,900	1,817,823.00	0.11
26	600115	中国东航	457,800	1,744,218.00	0.10
27	300335	迪森股份	357,000	1,738,590.00	0.10
28	003020	立方制药	117,020	1,733,066.20	0.10
29	601606	长城军工	61,300	1,685,137.00	0.10
30	000901	航天科技	93,800	1,668,702.00	0.10
31	002228	合兴包装	566,100	1,664,334.00	0.10
32	002879	长缆科技	121,700	1,597,921.00	0.09
33	300132	青松股份	278,100	1,579,608.00	0.09
34	002328	新朋股份	215,000	1,578,100.00	0.09
35	002916	深南电路	3,400	1,556,860.00	0.09
36	002140	东华科技	169,200	1,551,564.00	0.09
37	603132	金徽股份	98,400	1,533,072.00	0.09
38	600738	丽尚国潮	423,900	1,526,040.00	0.09
39	300279	和晶科技	238,900	1,445,345.00	0.08
40	002523	天桥起重	467,200	1,392,256.00	0.08
41	603017	中衡设计	137,600	1,369,120.00	0.08
42	600710	苏美达	141,800	1,355,608.00	0.08
43	600969	郴电国际	175,900	1,342,117.00	0.08
44	002064	华峰化学	140,000	1,328,600.00	0.08
45	605299	舒华体育	99,500	1,328,325.00	0.08
46	603101	汇嘉时代	207,100	1,292,304.00	0.08
47	000021	深科技	20,100	1,291,827.00	0.08
48	300532	今天国际	206,840	1,288,613.20	0.08
49	688697	纽威数控	94,080	1,278,547.20	0.07
50	600299	安迪苏	161,800	1,270,130.00	0.07

51	600312	平高电气	71,700	1,266,222.00	0.07
52	601995	中金公司	34,848	1,259,755.20	0.07
53	000776	广发证券	53,600	1,254,240.00	0.07
54	002246	北化股份	66,400	1,248,320.00	0.07
55	688252	天德钰	51,880	1,245,120.00	0.07
56	301219	腾远钴业	22,720	1,245,056.00	0.07
57	002120	韵达股份	194,700	1,238,292.00	0.07
58	603998	方盛制药	134,300	1,212,729.00	0.07
59	000798	中水渔业	166,900	1,178,314.00	0.07
60	000975	山金国际	68,900	1,171,300.00	0.07
61	600547	山东黄金	50,700	1,170,663.00	0.07
62	600392	盛和资源	39,300	1,169,961.00	0.07
63	000762	西藏矿业	41,800	1,116,060.00	0.07
64	300932	三友联众	102,000	1,081,200.00	0.06
65	600100	同方股份	154,500	1,058,325.00	0.06
66	002757	南兴股份	58,500	1,055,925.00	0.06
67	002090	金智科技	119,300	1,054,612.00	0.06
68	600550	保变电气	89,800	1,053,354.00	0.06
69	000962	东方钽业	11,600	1,050,960.00	0.06
70	300509	新美星	123,800	1,037,444.00	0.06
71	002281	光迅科技	4,000	1,027,760.00	0.06
72	603095	越剑智能	70,000	1,002,400.00	0.06
73	002080	中材科技	11,000	990,000.00	0.06
74	300905	宝丽迪	18,800	951,280.00	0.06
75	600257	大湖股份	215,100	931,383.00	0.05
76	002478	常宝股份	149,600	924,528.00	0.05
77	300978	东箭科技	113,000	916,430.00	0.05
78	605056	咸亨国际	56,800	908,800.00	0.05
79	002826	易明医药	60,300	906,309.00	0.05
80	001299	美能能源	90,000	905,400.00	0.05
81	002236	大华股份	54,800	903,652.00	0.05

82	600435	北方导航	79,500	890,400.00	0.05
83	600583	海油工程	174,300	876,729.00	0.05
84	002540	亚太科技	185,000	863,950.00	0.05
85	301073	君亭酒店	46,500	846,300.00	0.05
86	601608	中信重工	172,100	820,917.00	0.05
87	603708	家家悦	95,500	819,390.00	0.05
88	600498	烽火通信	10,900	802,240.00	0.05
89	603897	长城科技	24,400	792,024.00	0.05
90	300215	电科院	120,000	790,800.00	0.05
91	002716	湖南白银	97,300	787,157.00	0.05
92	002532	天山铝业	72,000	772,560.00	0.05
93	002116	中国海诚	112,700	761,852.00	0.04
94	600489	中金黄金	41,725	753,136.25	0.04
95	002545	东方铁塔	46,300	750,986.00	0.04
96	002648	卫星化学	31,800	746,982.00	0.04
97	002632	道明光学	82,300	741,523.00	0.04
98	002380	科远智慧	21,300	728,034.00	0.04
99	600560	金自天正	65,500	725,740.00	0.04
100	300988	津荣天宇	46,300	723,669.00	0.04
101	600482	中国动力	21,900	718,320.00	0.04
102	300102	乾照光电	27,000	703,080.00	0.04
103	002134	天津普林	23,100	702,702.00	0.04
104	002969	嘉美包装	49,900	702,592.00	0.04
105	301439	泓淋电力	44,000	691,680.00	0.04
106	688648	中邮科技	18,800	687,140.00	0.04
107	300286	安科瑞	28,400	685,860.00	0.04
108	688586	江航装备	58,600	685,034.00	0.04
109	002398	垒知集团	182,100	682,875.00	0.04
110	300803	指南针	7,400	678,358.00	0.04
111	301360	荣旗科技	9,700	664,353.00	0.04
112	000933	神火股份	31,300	663,560.00	0.04

113	002947	恒铭达	8,600	654,030.00	0.04
114	002397	梦洁股份	169,100	645,962.00	0.04
115	002098	浔兴股份	100,700	644,480.00	0.04
116	688080	映翰通	14,900	644,425.00	0.04
117	300349	金卡智能	58,700	642,178.00	0.04
118	601968	宝钢包装	162,500	637,000.00	0.04
119	002998	优彩资源	97,600	635,376.00	0.04
120	002283	天润工业	65,700	634,005.00	0.04
121	000400	许继电气	29,200	633,640.00	0.04
122	603516	淳中科技	4,700	632,667.00	0.04
123	688159	有方科技	14,216	631,048.24	0.04
124	002823	凯中精密	43,600	620,864.00	0.04
125	300945	曼卡龙	56,200	608,646.00	0.04
126	002107	沃华医药	106,100	603,709.00	0.04
127	601002	晋亿实业	139,200	601,344.00	0.04
128	300320	海达股份	62,600	597,204.00	0.04
129	601007	金陵饭店	97,400	595,114.00	0.03
130	002284	亚太股份	62,000	588,380.00	0.03
131	600982	宁波能源	122,700	584,052.00	0.03
132	300400	劲拓股份	15,400	579,810.00	0.03
133	601218	吉鑫科技	134,800	579,640.00	0.03
134	000565	渝三峡 A	100,700	571,976.00	0.03
135	001316	润贝航科	17,200	567,256.00	0.03
136	002296	辉煌科技	63,700	565,656.00	0.03
137	603799	华友钴业	11,700	564,642.00	0.03
138	600502	安徽建工	129,400	562,890.00	0.03
139	600966	博汇纸业	116,700	557,826.00	0.03
140	600452	涪陵电力	58,500	545,805.00	0.03
141	603790	雅运股份	25,300	539,902.00	0.03
142	300993	玉马科技	55,300	537,516.00	0.03
143	300099	尤洛卡	84,900	536,568.00	0.03

144	600176	中国巨石	7,300	532,024.00	0.03
145	002676	顺威股份	106,400	529,872.00	0.03
146	603217	元利科技	23,500	527,105.00	0.03
147	600731	湖南海利	102,200	523,264.00	0.03
148	000923	河钢资源	42,100	522,461.00	0.03
149	002029	七匹狼	68,200	521,048.00	0.03
150	002922	伊戈尔	15,800	518,240.00	0.03
151	600425	青松建化	156,200	510,774.00	0.03
152	600361	创新新材	141,200	508,320.00	0.03
153	301329	信音电子	20,800	505,232.00	0.03
154	001283	豪鹏科技	10,300	504,906.00	0.03
155	603082	北自科技	12,000	504,480.00	0.03
156	002645	华宏科技	18,280	502,882.80	0.03
157	300843	胜蓝股份	3,200	500,000.00	0.03
158	603926	铁流股份	27,700	490,013.00	0.03
159	002178	延华智能	112,500	488,250.00	0.03
160	002636	金安国纪	4,000	479,880.00	0.03
161	002788	鹭燕医药	47,500	476,425.00	0.03
162	600780	通宝能源	80,900	474,074.00	0.03
163	605196	华通线缆	18,100	472,410.00	0.03
164	600251	冠农股份	53,800	464,832.00	0.03
165	300970	华绿生物	25,420	464,677.60	0.03
166	000408	藏格矿业	6,700	464,444.00	0.03
167	000001	平安银行	46,200	464,310.00	0.03
168	002049	紫光国微	5,200	461,500.00	0.03
169	688766	普冉股份	600	459,960.00	0.03
170	603933	睿能科技	20,200	455,510.00	0.03
171	300139	晓程科技	12,400	453,220.00	0.03
172	301397	溯联股份	13,800	446,568.00	0.03
173	002419	天虹股份	105,300	445,419.00	0.03
174	688981	中芯国际	2,800	444,696.00	0.03

175	601168	西部矿业	16,300	442,382.00	0.03
176	300898	熊猫乳品	23,900	433,068.00	0.03
177	603489	八方股份	15,300	427,788.00	0.03
178	300681	英搏尔	14,800	423,576.00	0.02
179	002429	兆驰股份	40,700	422,873.00	0.02
180	603948	建业股份	17,500	421,750.00	0.02
181	000949	新乡化纤	65,400	414,636.00	0.02
182	002363	隆基机械	68,100	409,962.00	0.02
183	603986	兆易创新	500	407,500.00	0.02
184	603061	金海通	800	401,776.00	0.02
185	300986	志特新材	23,300	399,595.00	0.02
186	603279	景津装备	33,000	396,000.00	0.02
187	600830	香溢融通	49,600	395,312.00	0.02
188	300910	瑞丰新材	14,030	393,401.20	0.02
189	002404	嘉欣丝绸	67,900	388,388.00	0.02
190	605138	盛泰集团	70,300	388,056.00	0.02
191	300458	全志科技	9,800	386,708.00	0.02
192	601918	新集能源	44,600	383,114.00	0.02
193	688475	萤石网络	14,001	382,927.35	0.02
194	002911	佛燃能源	40,300	382,447.00	0.02
195	002170	芭田股份	35,200	382,272.00	0.02
196	300308	中际旭创	300	381,000.00	0.02
197	605179	一鸣食品	30,100	378,357.00	0.02
198	002117	东港股份	48,000	378,240.00	0.02
199	601865	福莱特	35,900	377,309.00	0.02
200	001314	亿道信息	6,100	376,980.00	0.02
201	603893	瑞芯微	2,000	376,720.00	0.02
202	300515	三德科技	28,800	375,840.00	0.02
203	300857	协创数据	1,100	373,890.00	0.02
204	002517	恺英网络	23,000	373,750.00	0.02
205	603088	宁波精达	37,100	373,226.00	0.02

206	002602	世纪华通	26,400	372,240.00	0.02
207	001332	锡装股份	9,400	369,138.00	0.02
208	300407	凯发电气	34,000	367,200.00	0.02
209	601101	昊华能源	34,400	363,264.00	0.02
210	300864	南大环境	18,900	362,502.00	0.02
211	300360	炬华科技	30,300	356,025.00	0.02
212	300697	电工合金	23,200	351,480.00	0.02
213	002040	南京港	46,900	349,405.00	0.02
214	001872	招商港口	17,900	347,797.00	0.02
215	600259	中稀有色	3,400	345,474.00	0.02
216	300691	联合光电	21,100	333,591.00	0.02
217	600125	铁龙物流	65,700	333,099.00	0.02
218	001337	四川黄金	9,000	329,940.00	0.02
219	301021	英诺激光	2,700	329,130.00	0.02
220	002042	华孚时尚	96,500	329,065.00	0.02
221	600727	鲁北化工	48,600	326,592.00	0.02
222	600558	大西洋	64,600	319,124.00	0.02
223	300760	迈瑞医疗	2,300	312,409.00	0.02
224	002708	光洋股份	23,300	307,327.00	0.02
225	002271	东方雨虹	25,700	305,059.00	0.02
226	688309	恒誉环保	5,000	304,400.00	0.02
227	000426	兴业银锡	9,200	303,232.00	0.02
228	688400	凌云光	4,566	302,269.20	0.02
229	600785	新华百货	30,700	300,860.00	0.02
230	300475	香农芯创	1,000	300,000.00	0.02
231	600506	统一股份	21,500	298,635.00	0.02
232	600858	银座股份	67,100	295,911.00	0.02
233	603187	海容冷链	25,300	290,697.00	0.02
234	000100	TCL科技	49,900	290,418.00	0.02
235	000850	华茂股份	80,100	281,151.00	0.02
236	002833	弘亚数控	14,500	279,705.00	0.02

237	301377	鼎泰高科	500	275,450.00	0.02
238	688486	龙迅股份	4,320	274,665.60	0.02
239	000715	中兴商业	58,500	271,440.00	0.02
240	600335	国机汽车	57,900	270,972.00	0.02
241	002389	航天彩虹	15,200	270,104.00	0.02
242	603739	蔚蓝生物	23,400	269,802.00	0.02
243	301190	善水科技	16,800	269,304.00	0.02
244	300409	道氏技术	13,400	267,062.00	0.02
245	002259	升达林业	70,300	266,437.00	0.02
246	603380	易德龙	5,900	266,031.00	0.02
247	300050	世纪鼎利	44,400	262,848.00	0.02
248	000425	徐工机械	32,200	260,498.00	0.02
249	600406	国电南瑞	11,400	260,490.00	0.02
250	002763	汇洁股份	38,100	258,699.00	0.02
251	601988	中国银行	45,200	258,544.00	0.02
252	000570	苏常柴A	54,800	255,916.00	0.02
253	000528	柳工	33,800	255,190.00	0.01
254	301078	孩子王	37,500	253,500.00	0.01
255	001298	好上好	12,200	253,150.00	0.01
256	300590	移为通信	17,600	252,560.00	0.01
257	300373	扬杰科技	1,600	251,568.00	0.01
258	601328	交通银行	38,400	246,912.00	0.01
259	001358	兴欣新材	9,500	245,480.00	0.01
260	002824	和胜股份	7,000	242,060.00	0.01
261	301316	慧博云通	6,000	236,280.00	0.01
262	301079	邵阳液压	7,000	235,480.00	0.01
263	300980	祥源新材	8,000	235,280.00	0.01
264	603737	三棵树	9,700	233,770.00	0.01
265	600372	中航机载	21,200	230,020.00	0.01
266	605289	罗曼股份	1,580	229,100.00	0.01
267	688128	中国电研	9,600	227,904.00	0.01

268	300138	晨光生物	25,200	226,800.00	0.01
269	002345	潮宏基	24,700	226,499.00	0.01
270	002683	广东宏大	7,700	225,533.00	0.01
271	301129	瑞纳智能	10,600	221,222.00	0.01
272	600496	精工钢构	70,400	218,240.00	0.01
273	301057	汇隆新材	9,400	216,200.00	0.01
274	000738	航发控制	11,700	213,993.00	0.01
275	002454	松芝股份	44,600	213,188.00	0.01
276	688558	国盛智科	6,400	210,304.00	0.01
277	601916	浙商银行	79,800	209,874.00	0.01
278	600693	东百集团	26,500	207,760.00	0.01
279	300790	宇瞳光学	7,900	206,269.00	0.01
280	002479	富春环保	48,600	204,606.00	0.01
281	301279	金道科技	9,200	199,916.00	0.01
282	000166	申万宏源	44,800	197,120.00	0.01
283	002811	郑中设计	17,300	193,587.00	0.01
284	300822	贝仕达克	16,300	190,710.00	0.01
285	300881	盛德鑫泰	5,000	187,250.00	0.01
286	605169	洪通燃气	20,900	185,801.00	0.01
287	603181	皇马科技	11,400	184,908.00	0.01
288	603299	苏盐井神	21,000	184,590.00	0.01
289	000589	贵州轮胎	45,300	183,918.00	0.01
290	002156	通富微电	2,400	182,088.00	0.01
291	300919	中伟新材	4,100	179,375.00	0.01
292	600171	上海贝岭	5,600	178,864.00	0.01
293	300927	江天化学	8,200	176,546.00	0.01
294	300063	天龙集团	20,300	176,204.00	0.01
295	000600	建投能源	20,100	175,875.00	0.01
296	601138	工业富联	2,400	173,160.00	0.01
296	600206	有研新材	2,600	173,160.00	0.01
297	301283	聚胶股份	7,000	171,360.00	0.01

298	688678	福立旺	7,000	169,190.00	0.01
299	300191	潜能恒信	6,100	168,665.00	0.01
300	002297	博云新材	5,800	168,142.00	0.01
301	300995	奇德新材	6,200	166,222.00	0.01
302	600875	东方电气	5,700	163,989.00	0.01
303	601330	绿色动力	23,400	163,098.00	0.01
304	300017	网宿科技	12,500	162,625.00	0.01
305	600903	贵州燃气	24,100	160,024.00	0.01
306	600339	中油工程	52,100	159,947.00	0.01
307	600546	山煤国际	14,600	159,578.00	0.01
308	601339	百隆东方	23,300	157,741.00	0.01
309	002734	利民股份	9,100	156,247.00	0.01
310	300473	德尔股份	5,100	155,040.00	0.01
311	603283	赛腾股份	1,900	153,862.00	0.01
312	301077	星华新材	6,800	153,544.00	0.01
313	300913	兆龙互连	3,200	153,312.00	0.01
314	688709	成都华微	4,000	152,360.00	0.01
315	600988	赤峰黄金	5,700	150,024.00	0.01
316	000301	东方盛虹	13,100	149,995.00	0.01
317	603296	华勤技术	2,000	148,540.00	0.01
318	000786	北新建材	8,200	148,338.00	0.01
319	001226	拓山重工	3,100	147,095.00	0.01
320	301175	中科环保	29,700	147,015.00	0.01
321	002166	莱茵生物	22,800	143,184.00	0.01
322	002020	京新药业	11,400	142,386.00	0.01
323	601216	君正集团	31,900	142,274.00	0.01
324	603486	科沃斯	2,800	142,100.00	0.01
325	300241	瑞丰光电	19,600	141,904.00	0.01
326	688230	芯导科技	1,800	141,858.00	0.01
327	603885	吉祥航空	13,700	140,973.00	0.01
328	603929	亚翔集成	500	136,010.00	0.01

329	300953	震裕科技	1,000	133,700.00	0.01
330	301087	可孚医疗	2,800	133,420.00	0.01
331	600027	华电国际	29,900	133,055.00	0.01
332	600970	中材国际	18,200	129,766.00	0.01
333	300661	圣邦股份	900	129,132.00	0.01
334	000419	通程控股	28,100	126,731.00	0.01
335	002756	永兴材料	2,200	124,608.00	0.01
336	300452	山河药辅	10,600	123,808.00	0.01
337	000407	胜利股份	33,000	122,100.00	0.01
338	002644	佛慈制药	17,800	121,218.00	0.01
339	688208	道通科技	4,800	120,912.00	0.01
340	000672	上峰材料	5,100	120,768.00	0.01
341	002556	辉隆股份	26,400	118,272.00	0.01
342	300415	伊之密	5,900	117,469.00	0.01
343	002629	仁智股份	27,300	117,390.00	0.01
344	300812	易天股份	4,000	117,240.00	0.01
345	301267	华夏眼科	8,000	116,720.00	0.01
346	001376	百通能源	11,200	116,480.00	0.01
347	002401	中远海科	10,000	116,100.00	0.01
348	603993	洛阳钼业	6,500	114,075.00	0.01
349	002558	巨人网络	4,100	112,996.00	0.01
350	600356	恒丰纸业	15,000	111,150.00	0.01
351	601398	工商银行	15,500	109,585.00	0.01
352	601869	长飞光纤	200	109,180.00	0.01
353	603556	海兴电力	4,900	107,800.00	0.01
354	600050	中国联通	25,900	103,600.00	0.01
355	002009	天奇股份	5,000	103,400.00	0.01
356	002016	世荣兆业	25,800	103,200.00	0.01
357	002935	天奥电子	4,700	103,118.00	0.01
358	301120	新特电气	6,200	103,106.00	0.01
359	002083	孚日股份	9,800	102,802.00	0.01

360	301295	美硕科技	2,400	101,232.00	0.01
361	300491	通合科技	2,600	99,294.00	0.01
362	600967	内蒙一机	9,100	98,735.00	0.01
363	000800	一汽解放	16,500	98,175.00	0.01
364	002390	信邦制药	37,600	98,136.00	0.01
365	300622	博士眼镜	7,000	97,580.00	0.01
366	002046	国机精工	1,300	95,745.00	0.01
367	600926	杭州银行	6,600	95,370.00	0.01
368	688025	杰普特	200	94,000.00	0.01
369	002565	顺灏股份	7,400	93,758.00	0.01
370	000531	穗恒运 A	15,600	93,444.00	0.01
371	001378	德冠新材	5,200	93,132.00	0.01
372	301137	哈焊华通	2,704	92,909.44	0.01
373	002158	汉钟精机	2,500	92,700.00	0.01
374	600739	辽宁成大	9,100	92,001.00	0.01
375	000875	电投绿能	17,800	91,670.00	0.01
376	601998	中信银行	13,200	91,476.00	0.01
377	601377	兴业证券	14,900	89,996.00	0.01
378	688279	峰昭科技	400	89,776.00	0.01
379	603271	永杰新材	2,000	88,900.00	0.01
380	601939	建设银行	9,200	88,596.00	0.01
381	601388	怡球资源	31,200	88,296.00	0.01
382	603031	安孚科技	1,600	85,200.00	0.00
383	301026	浩通科技	4,200	84,924.00	0.00
384	000997	新大陆	5,100	83,130.00	0.00
385	603112	华翔股份	4,950	82,813.50	0.00
386	002096	易普力	9,400	82,532.00	0.00
387	603967	中创物流	7,900	81,765.00	0.00
388	688045	必易微	1,000	80,780.00	0.00
389	300388	节能国祯	13,060	80,580.20	0.00
390	000537	绿发电力	11,000	80,410.00	0.00

391	600011	华能国际	10,500	79,695.00	0.00
392	603507	振江股份	2,400	78,936.00	0.00
393	002697	红旗连锁	18,400	76,544.00	0.00
394	002376	新北洋	13,300	76,475.00	0.00
395	600814	杭州解百	12,500	76,250.00	0.00
396	600458	时代新材	4,600	76,130.00	0.00
397	603165	荣晟环保	5,800	75,574.00	0.00
398	002560	通达股份	10,100	75,144.00	0.00
399	605287	德才股份	1,800	74,682.00	0.00
400	300223	北京君正	300	74,670.00	0.00
401	000703	恒逸石化	5,500	74,635.00	0.00
402	603871	嘉友国际	7,300	74,533.00	0.00
403	301048	金鹰重工	8,600	74,046.00	0.00
404	002179	中航光电	1,600	73,920.00	0.00
405	000950	重药控股	14,700	73,647.00	0.00
406	000733	振华科技	1,300	73,632.00	0.00
407	301149	隆华新材	6,900	73,002.00	0.00
408	688779	五矿新能	9,000	72,990.00	0.00
409	688536	思瑞浦	200	72,818.00	0.00
410	301200	大族数控	200	72,130.00	0.00
411	003031	中瓷电子	400	72,120.00	0.00
412	601089	福元医药	4,400	71,632.00	0.00
413	300979	华利集团	2,400	71,400.00	0.00
414	300908	仲景食品	3,200	70,528.00	0.00
415	002942	新农股份	4,900	70,217.00	0.00
416	601579	会稽山	4,700	69,043.00	0.00
417	300206	理邦仪器	5,600	68,488.00	0.00
418	300604	长川科技	200	68,284.00	0.00
419	600114	东睦股份	1,800	67,968.00	0.00
420	300797	钢研纳克	5,100	67,626.00	0.00
421	000655	金岭矿业	10,600	67,416.00	0.00

422	601677	明泰铝业	4,000	66,400.00	0.00
423	300701	森霸传感	6,900	66,033.00	0.00
424	002320	海峡股份	10,300	64,581.00	0.00
425	000526	学大教育	2,500	63,450.00	0.00
426	600284	浦东建设	13,000	63,180.00	0.00
427	603966	法兰泰克	7,700	62,755.00	0.00
428	000968	蓝焰控股	10,400	62,296.00	0.00
429	688002	睿创微纳	400	61,876.00	0.00
430	603390	通达电气	5,900	61,596.00	0.00
431	001965	招商公路	6,600	60,456.00	0.00
432	600130	波导股份	13,600	60,248.00	0.00
433	002582	好想你	7,100	59,995.00	0.00
434	002394	联发股份	6,700	59,764.00	0.00
435	600549	厦门钨业	700	59,640.00	0.00
436	603518	锦泓集团	8,300	59,345.00	0.00
437	300058	蓝色光标	4,300	59,168.00	0.00
438	603989	艾华集团	1,100	57,750.00	0.00
439	601038	一拖股份	5,400	57,186.00	0.00
440	000683	博源化工	9,900	57,024.00	0.00
441	002498	汉缆股份	8,300	56,606.00	0.00
442	300389	艾比森	4,400	56,408.00	0.00
443	600916	中国黄金	8,100	55,404.00	0.00
444	002155	湖南黄金	2,300	54,901.00	0.00
445	300233	金城医药	4,400	54,560.00	0.00
446	002001	新 和 成	1,900	53,998.00	0.00
447	002887	绿茵生态	5,100	53,397.00	0.00
448	605398	新炬网络	2,700	53,325.00	0.00
449	688503	聚和材料	400	53,080.00	0.00
450	688183	生益电子	400	52,960.00	0.00
451	301020	密封科技	2,400	52,416.00	0.00
452	600362	江西铜业	1,200	51,960.00	0.00

453	601288	农业银行	8,400	50,988.00	0.00
454	002256	兆新股份	14,000	50,820.00	0.00
455	600267	海正药业	5,000	50,550.00	0.00
456	000690	宝新能源	10,500	49,350.00	0.00
457	300840	酷特智能	2,300	47,449.00	0.00
458	300414	中光防雷	4,300	47,386.00	0.00
459	000700	模塑科技	3,200	47,232.00	0.00
460	600790	轻纺城	14,300	46,761.00	0.00
461	300130	新国都	2,200	46,288.00	0.00
462	603696	安记食品	4,000	46,000.00	0.00
463	002877	智能自控	6,100	42,944.00	0.00
464	002054	德美化工	6,400	42,560.00	0.00
465	688722	同益中	2,800	42,476.00	0.00
466	000807	云铝股份	1,900	42,066.00	0.00
467	600787	中储股份	9,900	41,382.00	0.00
468	002849	威星智能	2,400	40,608.00	0.00
469	300222	科大智能	2,900	40,165.00	0.00
470	301291	明阳电气	1,100	39,589.00	0.00
471	600019	宝钢股份	7,200	39,096.00	0.00
472	688127	蓝特光学	400	39,040.00	0.00
473	603266	天龙股份	2,300	38,709.00	0.00
474	605118	力鼎光电	1,100	38,379.00	0.00
475	002960	青鸟智控	4,500	38,115.00	0.00
476	300885	海昌新材	1,600	38,032.00	0.00
477	002984	森麒麟	2,900	37,903.00	0.00
478	603558	健盛集团	3,400	37,706.00	0.00
479	688181	八亿时空	600	37,560.00	0.00
480	300043	星辉娱乐	8,500	36,975.00	0.00
481	688093	世华科技	1,000	36,900.00	0.00
482	603115	海星股份	300	36,741.00	0.00
483	600919	江苏银行	3,400	36,652.00	0.00

484	601566	九牧王	4,500	36,585.00	0.00
485	300584	海辰药业	1,000	36,230.00	0.00
486	002081	金螳螂	8,100	35,073.00	0.00
487	300896	爱美客	400	34,880.00	0.00
488	002079	苏州固锝	2,300	34,569.00	0.00
489	002690	美亚光电	2,400	34,392.00	0.00
490	603726	朗迪集团	1,000	34,250.00	0.00
491	002412	汉森制药	6,100	33,550.00	0.00
492	002864	盘龙药业	1,300	33,540.00	0.00
493	605162	新中港	4,300	33,153.00	0.00
494	002451	摩恩电气	4,700	33,088.00	0.00
495	002722	物产金轮	2,800	33,012.00	0.00
496	301179	泽宇智能	1,600	32,736.00	0.00
497	301025	读客文化	4,200	32,592.00	0.00
498	600816	建元信托	13,300	32,452.00	0.00
499	600681	百川能源	9,700	31,331.00	0.00
500	000333	美的集团	400	30,212.00	0.00
501	601567	三星电气	2,000	29,880.00	0.00
502	603383	顶点软件	1,100	29,216.00	0.00
503	002443	金洲管道	3,000	28,590.00	0.00
504	002919	名臣健康	1,500	28,485.00	0.00
505	002358	森源电气	5,100	28,305.00	0.00
506	002270	华明装备	1,500	28,275.00	0.00
507	300486	东杰智能	1,300	27,755.00	0.00
508	002241	歌尔股份	1,200	27,036.00	0.00
509	600601	方正科技	1,600	22,144.00	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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金
---	------	------	----------	-------

号				资产净值比例(%)
1	600506	统一股份	13,179,943.90	0.77
2	002140	东华科技	12,115,730.00	0.71
3	002415	海康威视	11,340,878.00	0.67
4	603126	中材节能	9,538,550.00	0.56
5	000657	中钨高新	8,970,423.00	0.53
6	000554	泰山石油	8,969,818.00	0.53
7	002057	中钢天源	8,493,027.00	0.50
8	300073	当升科技	8,306,760.00	0.49
9	000026	飞亚达	8,201,928.00	0.48
10	000922	佳电股份	7,988,785.80	0.47
11	600469	风神股份	7,325,745.00	0.43
12	688631	莱斯信息	7,241,734.03	0.42
13	600391	航发科技	7,039,175.00	0.41
14	002643	万润股份	6,958,878.00	0.41
15	688475	萤石网络	6,905,367.11	0.40
16	600206	有研新材	6,759,587.37	0.40
17	601798	蓝科高新	6,608,055.00	0.39
18	688456	有研粉材	6,293,083.18	0.37
19	601995	中金公司	6,289,375.72	0.37
20	600830	香溢融通	6,277,279.00	0.37

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600506	统一股份	12,696,472.90	0.74

2	002140	东华科技	9,933,627.00	0.58
3	000922	佳电股份	8,586,098.60	0.50
4	000657	中钨高新	8,276,655.00	0.49
5	688456	有研粉材	7,561,694.51	0.44
6	600206	有研新材	7,201,584.80	0.42
7	688631	莱斯信息	7,117,923.67	0.42
8	600962	国投中鲁	6,761,084.00	0.40
9	603126	中材节能	6,646,712.00	0.39
10	002057	中钢天源	6,334,234.00	0.37
11	301137	哈焊华通	6,266,090.64	0.37
12	688475	萤石网络	5,888,431.00	0.35
13	600552	凯盛科技	5,805,945.00	0.34
14	000026	飞亚达	5,642,184.00	0.33
15	600505	西昌电力	5,538,458.00	0.32
16	688285	高铁电气	5,491,583.77	0.32
17	600391	航发科技	5,451,612.00	0.32
18	600961	株冶集团	5,327,394.02	0.31
19	601995	中金公司	5,100,289.00	0.30
20	300747	锐科激光	5,073,080.00	0.30

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	1,192,737,672.19
卖出股票收入（成交）总额	926,285,939.07

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	123,390,960.96	7.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	589,626,250.79	34.58
	其中：政策性金融债	529,039,734.63	31.02
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	149,729,764.21	8.78
9	其他	10,194,872.93	0.60
10	合计	872,941,848.89	51.19

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	240322	24进出22	1,500,000	151,280,465.75	8.87
2	019827	26国债01	1,000,000	100,648,191.78	5.90
3	092603101	26进出清发贴现01	1,000,000	99,898,430.77	5.86
4	190209	19国开09	500,000	51,678,835.62	3.03
5	170405	17农发05	500,000	51,578,219.18	3.02

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或者在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（1）2025年9月12日，国家金融监督管理总局公示行政处罚决定书，给予中国进出口银行罚款130万元的行政处罚。

2026年3月5日，国家外汇管理局北京市分局公示京汇罚〔2026〕14号行政处罚决定书，给予中国进出口银行警告、没收违法所得、罚款，罚没共计221.24万元的行政处罚。

2025年7月25日，国家外汇管理局北京市分局公示京汇罚〔2025〕30号行政处罚决定书，给予国家开发银行警告、没收违法所得、罚款，罚没共计1394.42万元的行政处罚。

2025年9月30日，中国人民银行公示银罚决字〔2025〕66号行政处罚决定书，给予国家开发银行警告、罚款123万元的行政处罚。

2025年8月1日，国家金融监督管理总局公示行政处罚决定书，给予中国农业发展银行罚款1020万元的行政处罚。

2025年12月5日，国家金融监督管理总局公示行政处罚决定书，给予兴业银行股份有限公司罚款720万元的行政处罚。

2025年9月12日，国家金融监督管理总局公示行政处罚决定书，给予中信银行股份有限公司罚款550万元的行政处罚。

2025年9月30日，中国人民银行公示银罚决字〔2025〕60号行政处罚决定书，给予中信银行股份有限公司警告、罚款1535.7万元的行政处罚。

2026年6月5日，国家金融监督管理总局公示行政处罚决定书，给予中信银行股份有限公司罚款1140万元的行政处罚。

2025年9月12日，国家金融监督管理总局公示行政处罚决定书，给予广发银行股份有限公司罚款6670万元的行政处罚。

2025年11月27日，国家外汇管理局广东省分局公示粤汇处〔2025〕16号行政处罚决定书，给予广发银行股份有限公司警告、罚款、没收违法所得，罚没共计1537.83万元的行政处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

（2）报告期内本基金投资的前十名证券中，其他证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

无。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
博道 衍和 债券A	780	167,825.36	21,996,751.98	16.80%	108,907,030.39	83.20%
博道 衍和 债券C	6,830	232,279.20	75,879,634.14	4.78%	1,510,587,298.71	95.22%
合计	7,574	226,745.54	97,876,386.12	5.70%	1,619,494,329.10	94.30%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博道衍和债券A	0.00	0.00%
	博道衍和债券C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博道衍和债券A	0
	博道衍和债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	博道衍和债券A	0
	博道衍和债券C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道衍和债券A	博道衍和债券C
基金合同生效日(2026年04月22日)基金份额总额	130,903,782.37	1,586,466,932.85
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	130,903,782.37	1,586,466,932.85

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容诚会计师事务所(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	
中信证券（华南）	2	2,119,023,611.26	100.00%	425,030.54	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
中信证券（华南）	737,735,678.63	100.00%	32,052,940,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：

- 1、上述交易单元均为本基金新增交易单元；
- 2、基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：
 - （1）经营行为稳健规范，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关于博道衍和债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
2	博道基金管理有限公司关于提醒客户及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-03

§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衍和债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道衍和债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道衍和债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道衍和债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道衍和债券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、报告期内博道衍和债券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