

# 博道久航混合型证券投资基金

2021 年第 1 季度报告

2021 年 03 月 31 日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:兴业证券股份有限公司

报告送出日期:2021 年 04 月 22 日

## 目录

|   |    |
|---|----|
| §1 重要提示.....                                  | 3  |
| §2 基金产品概况.....                                | 3  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现.....                         | 4  |
| 3.1 主要财务指标.....                               | 4  |
| 3.2 基金净值表现.....                               | 4  |
| §4 管理人报告.....                                 | 6  |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介.....                      | 6  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....               | 7  |
| 4.3 公平交易专项说明.....                             | 7  |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析.....                     | 8  |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现.....                          | 9  |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....                | 9  |
| §5 投资组合报告.....                                | 9  |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况.....                         | 9  |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                     | 9  |
| 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细.....     | 10 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....                   | 11 |
| 5.5 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债券投资明细.....     | 11 |
| 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细..... | 11 |
| 5.7 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.....    | 12 |
| 5.8 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权证投资明细.....     | 12 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....                 | 12 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....                | 12 |
| 5.11 投资组合报告附注.....                            | 12 |
| §6 开放式基金份额变动.....                             | 13 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....                    | 13 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....                     | 14 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....                 | 14 |
| §8 备查文件目录.....                                | 14 |
| 8.1 备查文件目录.....                               | 14 |
| 8.2 存放地点.....                                 | 14 |
| 8.3 查阅方式.....                                 | 14 |

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人兴业证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年03月31日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 博道久航混合   |
| 基金主代码      | 008318   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2019年12月24日  |
| 报告期末基金份额总额 | 406,066,483.39份  |
| 投资目标       | 本基金通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。  |
| 投资策略       | 本基金充分发挥基金管理人的研究优势，结合宏观基本面、指数价量特征、风险偏好、资金流向等多维度因素的分析，确定和调整资产配置比例，根据对市场环境以及股票估值、成长、盈利能力、营运质量、事件性因素、价量特征等因子表现的判断挑选个股构建股票组合，根据对利率、经济周期、宏观政策等因素的分析构建债券组合。 |
| 业绩比较基准     | 中证800指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%   |
| 风险收益特征     | 本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。   |
| 基金管理人      | 博道基金管理有限公司   |

|                 |                 |                 |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 基金托管人           | 兴业证券股份有限公司      |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 博道久航混合A         | 博道久航混合C         |
| 下属分级基金的交易代码     | 008318          | 008319          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 287,974,739.19份 | 118,091,744.20份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期(2021年01月01日 - 2021年03月31日) |                |
|-----------------|--------------------------------|----------------|
|                 | 博道久航混合A                        | 博道久航混合C        |
| 1. 本期已实现收益      | 30,167,582.82                  | 12,941,669.48  |
| 2. 本期利润         | -8,001,961.16                  | -1,310,743.46  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0251                        | -0.0095        |
| 4. 期末基金资产净值     | 389,421,896.46                 | 158,678,463.05 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.3523                         | 1.3437         |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博道久航混合A净值表现

| 阶段         | 净值增长率① | 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      | -2.68% | 1.57%     | -2.01%     | 1.19%         | -0.67% | 0.38% |
| 过去六个月      | 6.78%  | 1.29%     | 6.66%      | 1.01%         | 0.12%  | 0.28% |
| 过去一年       | 43.92% | 1.26%     | 27.20%     | 1.04%         | 16.72% | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 35.23% | 1.31%     | 22.33%     | 1.16%         | 12.90% | 0.15% |

博道久航混合C净值表现

| 阶段         | 净值增长率① | 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      | -2.80% | 1.57%     | -2.01%     | 1.19%         | -0.79% | 0.38% |
| 过去六个月      | 6.52%  | 1.29%     | 6.66%      | 1.01%         | -0.14% | 0.28% |
| 过去一年       | 43.21% | 1.26%     | 27.20%     | 1.04%         | 16.01% | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 34.37% | 1.31%     | 22.33%     | 1.16%         | 12.04% | 0.15% |

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

博道久航混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年12月24日-2021年03月31日)



注：本基金基金合同生效日为 2019 年 12 月 24 日，建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

博道久航混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2019 年 12 月 24 日，建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务  | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----|---|-------------|------|--------|---|
|    |   | 任职日期        | 离任日期 |        |   |
| 杨梦 | 博道启航混合、博道中证500增强、博道沪深300增强、博道远航混合、博道叁佰智航、博道伍佰智航、博道久航混合的基金经理、研究部副总经理 | 2019-12-24  | -    | 10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 |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>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，现任研究部副总经理。具有基金从业资格。自2018年8月10日起担任博道启航混合型证券投资基金基金经理至今、自2019年1月3日起担任博道中证500指数增强型证券投资基金基金经理至今、自2019年4月26日起担任博道沪深300指数增强型证券投资基金基金经理至今、自2019年4月30日起担任博道远航混合型证券投资基金基金经理至今、自2019年6月5日起担任博道叁佰智航股票型证券投资基金基金经理至今、自2019年9月26日起担任博道伍佰智航股票型证券投资基金基金经理至今、自2019年12月24日起担任博道久航混合型证券投资基金基金经理至今。</p> |
|--|--|--|--|--|

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立

公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，实现投资组合间公平交易分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司交易部和监察稽核部进行日常投资交易行为监控，监察稽核部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现违反公平交易的行为。

#### 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，本公司管理的所有投资组合未出现参与的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成交量的5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021年一季度，经济虽受疫情散发和春节因素影响有所波动，但整体经济修复的方向未变，同时，通胀预期有所升温，市场对全球流动性收紧有所担忧，一季度市场波动较大，春节后各大指数出现回调，具体而言，沪深300下跌3.13%，中证500下跌1.78%，创业板指下跌7.00%。从行业来看，钢铁、公用事业、银行、休闲服务等涨幅居前，国防军工、非银、通讯等下跌明显。从因子表现来看，春节前盈利预期因子表现比较好，春节后估值量价因子出现大幅反弹，因子轮动比较极端。

经济基本面来看，中国2020年四季度GDP同比增长6.5%，超市场预期且超过潜在增速水平，预计后续经济虽会受到信用扩张放缓的影响，但全球经济复苏，出口高景气的背景下整体仍将处于较高景气区间。通胀方面，在全球经济复苏的背景下，大宗商品价格显著上涨，全球流动性收紧预期有所强化，美债收益率快速上行，对全球长久期资产估值形成压制，股市风格从前期的极致核心资产转向均衡。政策方面，由于全球经济都处于复苏通道，今年政策退出的确定性较强，美联储货币政策是海外主要风险因素，就国内政策而言，其退出相较全球较为领先，有一定的缓冲空间，但后续仍需关心“稳杠杆”和“紧信用”的力度，以及通胀上行叠加名义增长冲高所带来的货币政策微调风险，不过整体仍然以“稳”为主，系统性影响相对可控。

报告期间，本基金维持配置中证800多因子选股增强模型（不受指数成分股占比约束的版本），受基本面类因子表现的拖累，产品在本报告期间略微跑输了业绩比较基准。

展望二季度，企业主动补库存正在进行中，而产业升级、全球供应链重塑和碳中和有望引领资本开支周期向上，经济增长和企业盈利延续高景气，虽然全球宽松政策退潮，



股票估值可能承压，但把握风格平衡，寻找估值与盈利增长速度及空间匹配度高的投资机会仍然可为。

本基金管理人将继续坚持量化多因子的选股思路，秉持勤勉尽责，力争为投资者获得有竞争力的超额收益。

#### 4.5 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。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)          | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|-------------------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 468,660,703.00 | 85.14            |
|    | 其中：股票             | 468,660,703.00 | 85.14            |
| 2  | 基金投资              | -              | -                |
| 3  | 固定收益投资            | 29,988,000.00  | 5.45             |
|    | 其中：债券             | 29,988,000.00  | 5.45             |
|    | 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      | 51,307,482.62  | 9.32             |
| 8  | 其他资产              | 528,655.51     | 0.10             |
| 9  | 合计                | 550,484,841.13 | 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。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 5.2.1 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         | 5,178,753.16   | 0.94         |
| B  | 采矿业              | 9,976,946.49   | 1.82         |
| C  | 制造业              | 273,565,462.01 | 49.91        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,481,860.76   | 0.82         |
| E  | 建筑业              | 3,040,821.00   | 0.55         |
| F  | 批发和零售业           | 2,353,212.82   | 0.43         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 4,816,274.72   | 0.88         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 1,381,575.00   | 0.25         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 16,386,925.27  | 2.99         |
| J  | 金融业              | 106,197,931.53 | 19.38        |
| K  | 房地产业             | 11,545,006.30  | 2.11         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 10,407,095.36  | 1.90         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 7,499,764.54   | 1.37         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 1,921,502.02   | 0.35         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 8,501,068.02   | 1.55         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 1,406,504.00   | 0.26         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 468,660,703.00 | 85.51        |

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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  | 601318 | 中国平安 | 352,197 | 27,717,903.90 | 5.06         |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 484,974 | 24,782,171.40 | 4.52         |

|    |        |      |         |               |      |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 9,100   | 18,281,900.00 | 3.34 |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 608,640 | 14,662,137.60 | 2.68 |
| 5  | 000858 | 五粮液  | 41,500  | 11,121,170.00 | 2.03 |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 134,300 | 11,043,489.00 | 2.01 |
| 7  | 600309 | 万华化学 | 94,051  | 9,931,785.60  | 1.81 |
| 8  | 600031 | 三一重工 | 269,500 | 9,203,425.00  | 1.68 |
| 9  | 000651 | 格力电器 | 136,600 | 8,564,820.00  | 1.56 |
| 10 | 601888 | 中国中免 | 25,042  | 7,664,855.36  | 1.40 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|-----------|---------------|------------------|
| 1  | 国家债券      | 29,988,000.00 | 5.47             |
| 2  | 央行票据      | -             | -                |
| 3  | 金融债券      | -             | -                |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -                |
| 4  | 企业债券      | -             | -                |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -                |
| 6  | 中期票据      | -             | -                |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -                |
| 8  | 同业存单      | -             | -                |
| 9  | 其他        | -             | -                |
| 10 | 合计        | 29,988,000.00 | 5.47             |

#### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量（张）   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|------------------|
| 1  | 019640 | 20国债10 | 300,000 | 29,988,000.00 | 5.47             |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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) 2020年8月31日，中国银保监会福建监管局对兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”，股票代码601166）作出行政处罚决定（闽银保监罚决字〔2020〕24号），因兴业银行同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保等行为，被给予没收违法所得6,361,807.97元，并合计处以罚款15,961,807.97元的行政处罚。2020年9月4日，中国人民银行福州中心支行对兴业银行作出行政处罚决定（福银罚字〔2020〕35号），因兴业银行为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；违反银行卡收单外包管理规定；未按规定履行客户身份识别义务，被给予警告，没收违法所得10,875,088.15元，并处13,824,431.23元罚款。2021年1月11日，中国银保监会消保局发布《关于兴业银行互联网保险销售违规问题的通报》（银保监消保发〔2021〕2号），因兴业银行通过互联网销售重疾险时未充分履行对免除保险公司责任条款的提示和明确说明义务，展示免除保险公司责任条款的单独页面内容严重缺失，互联网保险销售行为可回溯管理不健全，被给予通报批评处分。

本基金采用量化选股策略，兴业银行是根据选股模型批量选择出来的个股，由于该事件并未影响到模型的选股指标体系，且本基金认为对兴业银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响，所以本基金遵循量化模型的选股结果，继续投资该股票。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他九名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。

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

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | -          |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 468,637.23 |
| 5  | 应收申购款   | 60,018.28  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 528,655.51 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                               | 博道久航混合A        | 博道久航混合C        |
|-------------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 350,566,599.88 | 180,388,768.91 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 37,191,975.67  | 7,216,808.39   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 99,783,836.36  | 69,513,833.10  |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | -              | -              |
| 报告期期末基金份额总额                   | 287,974,739.19 | 118,091,744.20 |

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                          | 博道久航混合A      | 博道久航混合C      |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 1,999,800.18 | 1,000,200.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | 0.00         | 0.00         |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | 0.00         | 0.00         |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 1,999,800.18 | 1,000,200.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.49         | 0.25         |

注：

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则买入/申购总份额中包含该业务。
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则卖出/赎回总份额中包含该业务。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、转换、红利再投等。

## §8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

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

### 8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 8.3 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

2021年04月22日