

# 博道嘉丰混合型证券投资基金

2024年第2季度报告

2024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:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2024年07月19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               | 8  |
| 4.3 公平交易专项说明                             | 8  |
| 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                     | 10 |
| 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     | 11 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合                   | 12 |
| 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     | 12 |
| 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 | 12 |
| 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                 | 13 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明                | 13 |
| 5.11 投资组合报告附注                            | 13 |
| §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                    | 14 |
| 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                                 | 15 |
| 8.3 查阅方式                                 | 15 |

## §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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年7月17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2024年04月01日起至2024年06月30日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 博道嘉丰混合   |
| 基金主代码      | 010967   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2021年02月01日  |
| 报告期末基金份额总额 | 1,568,332,970.59份  |
| 投资目标       | 在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置和投资管理，追求超越基金业绩比较基准的长期资本增值。  |
| 投资策略       | 在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，确定并动态调整大类资产的投资比例。本基金坚持自上而下与自下而上相结合的投资理念，通过把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化，挑选出预期具有较好市场表现的行业；通过定量分析和定性分析相结合，优选基本面因素良好、估值水平合理的上市公司构建股票组合。此外，本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，本基金将优选基本面因素良好、估值水平合理的港股纳入本基金的股票投资组合。本基金债券投资策略主要包括久期管理策略、期限结构配置策略、类属配置策略、个券选择等积极的投资策略。 |

|                 |   |                 |
|-----------------|---|-----------------|
|                 | 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、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          | 中证800指数收益率×65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%  |                 |
| 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。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |                 |
| 基金管理人           | 博道基金管理有限公司  |                 |
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司  |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 博道嘉丰混合A   | 博道嘉丰混合C         |
| 下属分级基金的交易代码     | 010967  | 010968          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,252,038,612.97份   | 316,294,357.62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(2024年04月01日 - 2024年06月30日) |                |
|----------------|--------------------------------|----------------|
|                | 博道嘉丰混合A                        | 博道嘉丰混合C        |
| 1.本期已实现收益      | -31,479,725.24                 | -8,161,299.76  |
| 2.本期利润         | -34,240,721.19                 | -8,840,762.88  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0270                        | -0.0276        |
| 4.期末基金资产净值     | 800,739,027.04                 | 196,835,734.98 |
| 5.期末基金份额净值     | 0.6395                         | 0.6223         |

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

## 博道嘉丰混合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      | -4.11%  | 1.04%     | -1.06%     | 0.58%         | -3.05%  | 0.46% |
| 过去六个月      | -2.26%  | 1.36%     | 0.24%      | 0.73%         | -2.50%  | 0.63% |
| 过去一年       | -12.16% | 1.16%     | -7.51%     | 0.68%         | -4.65%  | 0.48% |
| 过去三年       | -40.13% | 1.28%     | -23.47%    | 0.77%         | -16.66% | 0.51% |
| 自基金合同生效起至今 | -36.05% | 1.26%     | -23.29%    | 0.78%         | -12.76% | 0.48% |

## 博道嘉丰混合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      | -4.31%  | 1.03%     | -1.06%     | 0.58%         | -3.25%  | 0.45% |
| 过去六个月      | -2.64%  | 1.36%     | 0.24%      | 0.73%         | -2.88%  | 0.63% |
| 过去一年       | -12.84% | 1.16%     | -7.51%     | 0.68%         | -5.33%  | 0.48% |
| 过去三年       | -41.55% | 1.28%     | -23.47%    | 0.77%         | -18.08% | 0.51% |
| 自基金合同生效起至今 | -37.77% | 1.26%     | -23.29%    | 0.78%         | -14.48% | 0.48% |

## 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

博道嘉丰混合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  
(2021年02月01日-2024年06月30日)



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。

博道嘉丰混合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  
(2021年02月01日-2024年06月30日)



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          | 离任 |        |    |
|    |    |             |    |        |    |

|     |  | 日期         | 日期 |     |  |
|-----|--|------------|----|-----|--|
| 张迎军 | 博道嘉泰回报混合、博道嘉瑞混合、博道嘉元混合、博道嘉兴一年持有期混合、博道嘉丰混合的基金经理、研究总监兼基金投资部总经理 | 2021-02-01 | -  | 24年 | 张迎军先生，中国籍，经济学硕士。2000年7月至2003年3月担任申银万国证券研究所市场研究部、策略研究部研究员，2003年4月至2006年11月担任中国太平洋保险（集团）股份有限公司资金运用管理中心投资经理，2006年12月至2008年5月担任太平洋资产管理有限公司组合管理部组合经理，2008年8月至2015年7月担任交银施罗德基金管理有限公司基金经理、固定收益部副总经理、权益部副总经理、投资副总监，2015年9月至2018年11月担任上海放山资产管理有限公司总经理。2019年5月加入博道基金管理有限公司，现任研究总监兼基金投资部总经理。具有基金从业资格。自2019年12月19日起担任博道嘉泰回报混合型证券投资基金基金经理至今、自2019年12月30日起担任博道嘉瑞混合型证券投资基金基金经理至今、自2020年3月4日起担任博道嘉元混合型证券投资基金基金经理至今、自2020年10月23日起担任博道嘉兴一年持有期混合型证券投资基金基金经理至今、自2021年2月1日起担任博道嘉丰混合型证券投资基金基金经理至今。 |

## 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

2024年二季度，A股市场在春节反弹后归于平淡，除港股恒生指数上涨7.12%外，A股市场各指数均有所下跌。沪深300下跌2.14%，中证500下跌6.50%，中证1000下跌10.02%，上证指数下跌2.43%，创业板指下跌7.41%。从行业来看，银行、电力、交运、煤炭表现较好，分别上涨了7.59%、5.31%、2.74%、2.33%，消费者服务、传媒、商贸零售、计算机表现较差，分别下跌20.38%、19.81%、16.21%、14.06%。

二季度本基金管理人对组合配置进行了调整，加大了对英伟达产业链及低估值高股息板块的配置比例，对部分成长股进行了减持。

2024年二季度，经济数据呈现出供给修复、需求回落的特征，结构上分化延续，景气度较高的主要是生产端、出口和电力投资，需求端和价格偏弱，整体仍然是量增价减的环境。政策端，4月政治局会议在稳增长方面释放了较为积极的信号，一定程度上消除了市场关于二季度财政和货币政策节奏和力度放缓的担忧；5月地产政策连续放松背景下，部分城市二手房成交有所好转。不过，当政策陆续出台后，逐渐从博弈转向兑现和验证，市场对地产企稳和盈利周期回升的信心仍然不足；同时，受大宗商品价格和海运费上涨的影响，叠加地缘政治和贸易摩擦加剧，出海链条出现一定程度调整，市场风险偏好有所下降。

目前A股市场持续延续弱势格局是多方面因素造成的。从市场层面分析，除了低估值的红利板块与类似于英伟达产业链等少数具有出海逻辑的细分行业板块外，市场缺乏持续性的领涨板块主线。在经历高速增长向高质量增长转型期中，部分行业依旧面临产能过剩的困扰，这对相关公司的毛利率、净利率及估值水平都会形成负面冲击。随着二十届三中全会的召开，财税体制改革重新划分地方与中央的财权与事权，建立全国统一大市场，可以预期在制度层面将对产能过剩产生的深层次原因有所改变。往后看，随着中国地产供求形势和新均衡的形成，我国将逐渐从债务驱动的高杠杆增长阶段，进入到创新驱动的高质量增长时代。对应的资本市场监管和金融统计方式都在发生变化，包括新国九条开启资本市场建设的新篇章、二季度统计局的金融增加值核算方式优化调整等，而更深层次的治理框架，包括财税、要素市场化等方面的蓝图也将在三中全会中逐渐勾勒，相关政策红利可能逐渐成为新的投资线索。

展望2024年下半年的沪深市场，我们预计2024年中国经济在2023年弱复苏的基础上将继续温和复苏，2024年经济增长对上市公司业绩增长的拉动效应或将显著好于2023年。新国九条各项政策措施逐步落地实施，对A股市场的利好效应将会是长期深远的，也将会给A股市场带来更好的投资机会。

本基金将坚持“以长期视角正确把握公司的合理价值，以合理价格买入优秀公司”基本原则，尊重市场、顺势而为，面对市场出现的新变化，在控制组合整体风险的前提下，保持开放心态努力参与，勤勉尽责，力争为投资者获得有竞争力的收益水平。

#### 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                  | 886,669,753.03 | 88.71            |
|    | 其中：股票                 | 886,669,753.03 | 88.71            |
| 2  | 基金投资                  | -              | -                |
| 3  | 固定收益投资                | 73,366,741.67  | 7.34             |
|    | 其中：债券                 | 73,366,741.67  | 7.34             |
|    | 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<br>返售金融资产 | -              | -                |
| 7  | 银行存款和结算备付金合<br>计      | 38,968,491.61  | 3.90             |
| 8  | 其他资产                  | 557,725.55     | 0.06             |
| 9  | 合计                    | 999,562,711.86 | 100.00           |

注：1、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；

2、本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值及占基金资产净值比例请见“5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合”部分披露。

## 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             | -              | -            |
| B  | 采矿业                  | 216,067,405.70 | 21.66        |
| C  | 制造业                  | 531,188,005.62 | 53.25        |
| D  | 电力、热力、燃气及水<br>生产和供应业 | 3,778,830.00   | 0.38         |
| E  | 建筑业                  | 26,811,042.00  | 2.69         |
| F  | 批发和零售业               | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政<br>业      | -              | -            |

|   |                 |                |       |
|---|-----------------|----------------|-------|
| H | 住宿和餐饮业          | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 38,476,128.58  | 3.86  |
| J | 金融业             | 25,398,197.10  | 2.55  |
| K | 房地产业            | -              | -     |
| L | 租赁和商务服务业        | -              | -     |
| M | 科学研究和技术服务业      | -              | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 20,077.68      | 0.00  |
| 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       | -              | -     |
| S | 综合              | -              | -     |
|   | 合计              | 841,739,686.68 | 84.38 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值(人民币)     | 占基金资产净值比例(%) |
|------|---------------|--------------|
| 可选消费 | 11,869,859.74 | 1.19         |
| 主要消费 | 12,649,379.73 | 1.27         |
| 房地产  | 20,410,826.88 | 2.05         |
| 合计   | 44,930,066.35 | 4.50         |

注：以上分类采用中证CICS一级分类标准编制。

### 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  | 300394 | 天孚通信 | 825,720   | 73,010,162.40 | 7.32         |
| 2  | 600150 | 中国船舶 | 1,495,700 | 60,889,947.00 | 6.10         |
| 3  | 300274 | 阳光电源 | 772,316   | 47,906,761.48 | 4.80         |
| 4  | 000625 | 长安汽车 | 3,306,700 | 44,408,981.00 | 4.45         |
| 5  | 300049 | 福瑞股份 | 810,542   | 40,802,684.28 | 4.09         |
| 6  | 600546 | 山煤国际 | 2,572,700 | 37,612,874.00 | 3.77         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 7  | 000603 | 盛达资源 | 3,048,300 | 36,061,389.00 | 3.61 |
| 8  | 300751 | 迈为股份 | 290,577   | 34,718,139.96 | 3.48 |
| 9  | 601138 | 工业富联 | 1,119,000 | 30,660,600.00 | 3.07 |
| 10 | 601001 | 晋控煤业 | 1,612,800 | 26,643,456.00 | 2.67 |

#### 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(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 52,209,108.25 | 5.23         |
| 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） | 21,157,633.42 | 2.12         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 73,366,741.67 | 7.35         |

#### 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(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019740 | 24国债09 | 292,000 | 29,299,824.00 | 2.94         |
| 2  | 019727 | 23国债24 | 225,000 | 22,909,284.25 | 2.30         |
| 3  | 110085 | 通22转债  | 200,040 | 21,157,633.42 | 2.12         |

**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**

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

**5.11 投资组合报告附注**

**5.11.1 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。**

**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    | 539,965.24 |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 17,760.31  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 557,725.55 |

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

| 序号 | 债券代码   | 债券名称  | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------------|--------------|
| 1  | 110085 | 通22转债 | 21,157,633.42 | 2.12         |

**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

|                               | 博道嘉丰混合A          | 博道嘉丰混合C        |
|-------------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 1,280,968,011.49 | 322,714,440.30 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 1,223,885.39     | 1,180,493.34   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 30,153,283.91    | 7,600,576.02   |
| 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                   | 1,252,038,612.97 | 316,294,357.62 |

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

|                          | 博道嘉丰混合A      | 博道嘉丰混合C      |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 5,217,008.99 | 1,000,166.66 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -            | -            |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -            | -            |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 5,217,008.99 | 1,000,166.66 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.42         | 0.32         |

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；  
3、分级基金“报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）”的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。非分级基金“报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）”的计算中，比例的分母采用期末基金份额总额。

### 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嘉丰混合型证券投资基金募集注册的文件；

- 2、《博道嘉丰混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道嘉丰混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道嘉丰混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道嘉丰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、报告期内博道嘉丰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](http://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

2024年07月19日