

# 博道中证A500指数增强型证券投资基金

## 2026年第2季度报告

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:平安银行股份有限公司

报告送出日期:2026年07月21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                               | 5  |
| §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                          | 8  |
| 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细          | 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     | 13 |
| 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                             | 14 |
| §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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026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2026年04月01日起至2026年06月30日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 博道中证A500指数增强                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 基金主代码      | 022745                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 基金合同生效日    | 2025年01月23日                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 报告期末基金份额总额 | 539,555,722.64份                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 投资目标       | 本基金为股票指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越标的指数的业绩表现。                                                                                                                                                                                                                   |
| 投资策略       | 本基金以中证A500指数为标的指数，通过量化选股模型构建股票组合，首先从满足一定基本面要求的备选股票池中，综合考虑股票的估值、成长、盈利能力、营运质量、事件性因素、价量特征等因子，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，然后利用投资组合优化工具，在控制跟踪偏离过大风险的同时，最大化组合的预期收益，以此来确定个股的投资权重。其中，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。股票组合构建完成后，本基金管理人将对组合运作绩效持续跟踪，根据市场的变化及时调整投资组合，在控制跟踪误差的基础上 |

|                 |                                                                                                 |                 |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|
|                 | 力求获得超越标的指数的业绩表现。本基金的股指期货投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。 |                 |
| 业绩比较基准          | 中证A500指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%                                                               |                 |
| 风险收益特征          | 本基金属于股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。      |                 |
| 基金管理人           | 博道基金管理有限公司                                                                                      |                 |
| 基金托管人           | 平安银行股份有限公司                                                                                      |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 博道中证A500指数增强A                                                                                   | 博道中证A500指数增强C   |
| 下属分级基金的交易代码     | 022745                                                                                          | 022746          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 315,227,710.65份                                                                                 | 224,328,011.99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(2026年04月01日 - 2026年06月30日) |                |
|----------------|--------------------------------|----------------|
|                | 博道中证A500指数增强A                  | 博道中证A500指数增强C  |
| 1.本期已实现收益      | 28,218,181.52                  | 19,553,263.88  |
| 2.本期利润         | 71,651,732.36                  | 53,141,197.64  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2253                         | 0.2319         |
| 4.期末基金资产净值     | 481,587,377.24                 | 340,759,152.32 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.5277                         | 1.5190         |

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

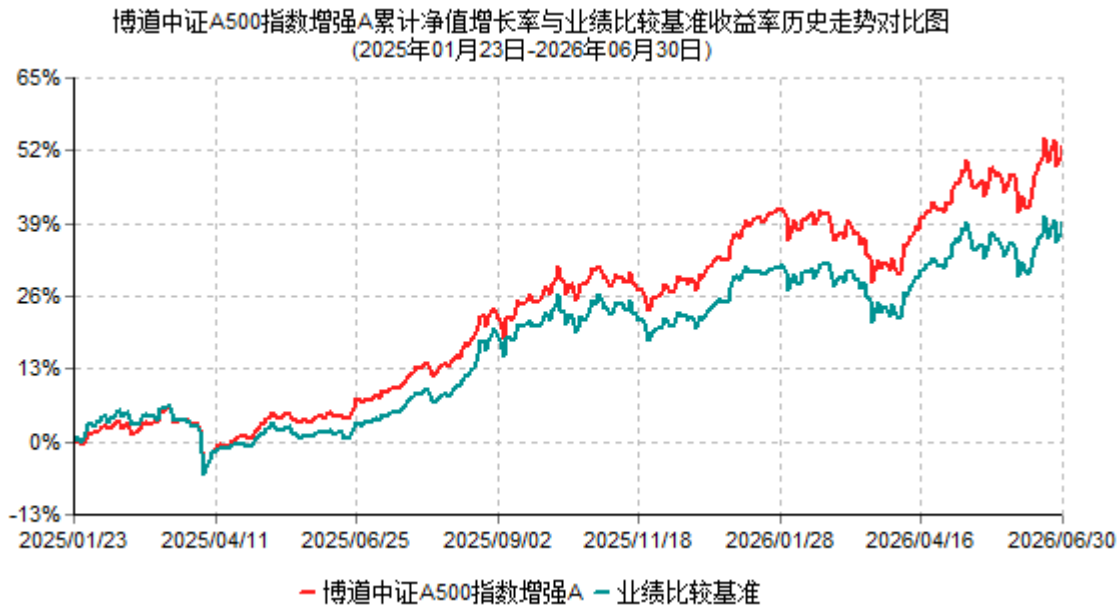
博道中证A500指数增强A净值表现

| 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      | 17.08% | 1.39%     | 13.54%     | 1.34%         | 3.54%  | 0.05% |
| 过去六个月      | 15.43% | 1.28%     | 11.34%     | 1.22%         | 4.09%  | 0.06% |
| 过去一年       | 42.07% | 1.10%     | 34.41%     | 1.09%         | 7.66%  | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 52.77% | 1.08%     | 39.13%     | 1.07%         | 13.64% | 0.01% |

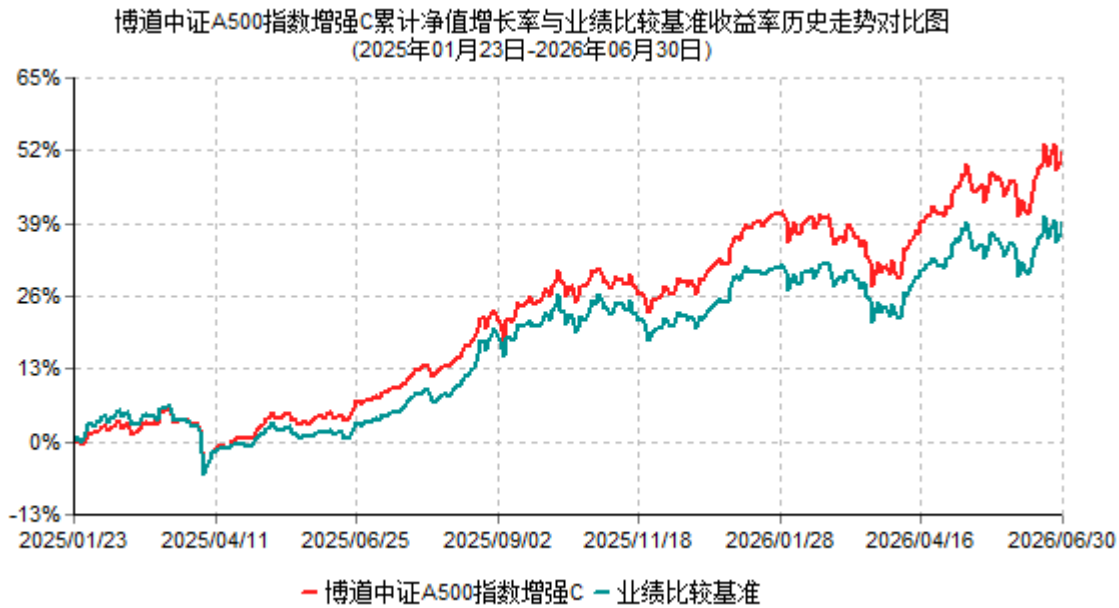
博道中证A500指数增强C净值表现

| 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      | 16.96% | 1.39%     | 13.54%     | 1.34%         | 3.42%  | 0.05% |
| 过去六个月      | 15.21% | 1.28%     | 11.34%     | 1.22%         | 3.87%  | 0.06% |
| 过去一年       | 41.51% | 1.10%     | 34.41%     | 1.09%         | 7.10%  | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 51.90% | 1.08%     | 39.13%     | 1.07%         | 12.77% | 0.01% |

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



注：本基金基金合同生效日为 2025 年 1 月 23 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。



注：本基金基金合同生效日为 2025 年 1 月 23 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<br>经理期限 | 证券<br>从业 | 说明 |
|----|----|-----------------|----------|----|
|----|----|-----------------|----------|----|

|    |                                                                                                                                                                     | 任职<br>日期   | 离任<br>日期 | 年限  |                                                                                                                                                             |
|----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|----------|-----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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 | 2025-01-23 | -        | 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。 |

#### 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，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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私募资产管理计划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，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3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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026年第二季度，美以伊冲突整体降级，全球科技股明显反弹。权益市场方面，A股普遍上行，但结构分化，上证指数上涨5.20%，沪深300上涨11.90%，中证500上涨18.56%，中证1000上涨15.62%，而恒生指数下跌7.69%。风格上，中信成长风格指数上涨37.25%，中信周期风格指数下跌6.47%，中信消费风格指数下跌10.75%，中信金融风格指数下跌4.27%，中信稳定风格指数下跌10.00%。行业层面，电子、通信、建材、机械涨幅居前，分别上涨89.88%、66.12%、34.75%、17.49%；消费者服务、农林牧渔、综合、综合金融跌幅较大，分别下跌21.84%、19.41%、18.18%、16.40%。

从因子层面来看，表征景气度的基本面因子依旧表现较好，价值类因子创下历史最大回撤，AI量价因子部分策略捕捉到了较强的动量效应，部分策略偏量价反转逻辑，超额有所回撤。极致的抱团风格下，量化策略的环境并不友好，传统框架多因子模型和AI全流程框架的多因子模型在二季度贡献相当。研究层面，博道量化团队继续围绕双均衡框架进行升级，以及推动组合优化与风控模块持续迭代。

报告期间，本基金维持配置中证A500多因子选股增强模型。

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。

#### 4.5 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

无。

§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                  | 766,316,479.86 | 91.58            |
|    | 其中：股票                 | 766,316,479.86 | 91.58            |
| 2  | 基金投资                  | -              | -                |
| 3  | 固定收益投资                | 40,949,930.02  | 4.89             |
|    | 其中：债券                 | 40,949,930.02  | 4.89             |
|    | 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              | 2,000.00       | 0.00             |
|    | 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      | 15,749,427.46  | 1.88             |
| 8  | 其他资产                  | 13,799,905.33  | 1.65             |
| 9  | 合计                    | 836,817,742.67 | 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（指数投资）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             | 2,715,224.00   | 0.33         |
| B  | 采矿业                  | 35,861,443.00  | 4.36         |
| C  | 制造业                  | 466,325,700.49 | 56.71        |
| D  | 电力、热力、燃气及水<br>生产和供应业 | 5,637,035.00   | 0.69         |

|   |                     |                |       |
|---|---------------------|----------------|-------|
| E | 建筑业                 | 198,628.00     | 0.02  |
| F | 批发和零售业              | 7,791,000.00   | 0.95  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业         | 14,719,881.78  | 1.79  |
| H | 住宿和餐饮业              | 80,808.00      | 0.01  |
| I | 信息传输、软件和信息<br>技术服务业 | 30,132,208.70  | 3.66  |
| J | 金融业                 | 90,995,207.30  | 11.07 |
| K | 房地产业                | 418,288.00     | 0.05  |
| L | 租赁和商务服务业            | 2,833,826.00   | 0.34  |
| M | 科学研究和技术服务业          | 7,781,875.00   | 0.95  |
| N | 水利、环境和公共设施<br>管理业   | 2,207,172.00   | 0.27  |
| O | 居民服务、修理和其他<br>服务业   | -              | -     |
| P | 教育                  | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作             | 970,550.00     | 0.12  |
| R | 文化、体育和娱乐业           | -              | -     |
| S | 综合                  | 134,320.00     | 0.02  |
|   | 合计                  | 668,803,167.27 | 81.33 |

### 5.2.2 报告期末（积极投资）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                  | 3,816,215.82  | 0.46         |
| C  | 制造业                  | 76,456,280.09 | 9.30         |
| D  | 电力、热力、燃气及水<br>生产和供应业 | 2,514,086.22  | 0.31         |
| E  | 建筑业                  | 551,834.00    | 0.07         |
| F  | 批发和零售业               | 333,216.00    | 0.04         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政<br>业      | 384,873.46    | 0.05         |
| H  | 住宿和餐饮业               | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息           | 1,100,512.00  | 0.13         |

|   |                   |               |       |
|---|-------------------|---------------|-------|
|   | 技术服务业             |               |       |
| J | 金融业               | 7,087,216.00  | 0.86  |
| K | 房地产业              | 72,300.00     | 0.01  |
| L | 租赁和商务服务业          | 156,726.00    | 0.02  |
| M | 科学研究和技术服务业        | 1,730,262.00  | 0.21  |
| N | 水利、环境和公共设施<br>管理业 | 3,309,791.00  | 0.40  |
| O | 居民服务、修理和其他<br>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                | 97,513,312.59 | 11.86 |

5.2.3 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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  | 300308 | 中际旭创 | 30,500  | 38,735,000.00 | 4.71         |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 67,100  | 26,370,971.00 | 3.21         |
| 3  | 300502 | 新易盛  | 32,684  | 19,839,188.00 | 2.41         |
| 4  | 603986 | 兆易创新 | 20,900  | 17,033,500.00 | 2.07         |
| 5  | 600519 | 贵州茅台 | 12,300  | 14,581,527.00 | 1.77         |
| 6  | 601601 | 中国太保 | 471,000 | 13,432,920.00 | 1.63         |
| 7  | 688256 | 寒武纪  | 8,274   | 13,201,580.70 | 1.61         |
| 8  | 600036 | 招商银行 | 357,800 | 12,701,900.00 | 1.54         |
| 9  | 002384 | 东山精密 | 46,100  | 12,094,335.00 | 1.47         |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 148,100 | 10,426,240.00 | 1.27         |

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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  | 002716 | 湖南白银 | 466,700 | 3,775,603.00 | 0.46         |
| 2  | 688110 | 东芯股份 | 15,200  | 3,096,240.00 | 0.38         |
| 3  | 000776 | 广发证券 | 131,900 | 3,086,460.00 | 0.38         |
| 4  | 002969 | 嘉美包装 | 216,700 | 3,051,136.00 | 0.37         |
| 5  | 001359 | 平安电工 | 24,300  | 3,043,575.00 | 0.37         |

#### 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      | 40,949,930.02 | 4.98         |
| 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        | 40,949,930.02 | 4.98         |

#### 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  | 019827 | 26国债01 | 181,000 | 18,217,322.71 | 2.22         |
| 2  | 019785 | 25国债13 | 109,900 | 11,128,754.02 | 1.35         |
| 3  | 019792 | 25国债19 | 96,000  | 9,700,726.36  | 1.18         |
| 4  | 019835 | 26国债09 | 19,000  | 1,903,126.93  | 0.23         |

**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 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，给予招商银行股份有限公司警告并罚款60万元的行政处罚。

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。

5.11.2 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。

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    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 13,799,905.33 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 13,799,905.33 |

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

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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

|                               | 博道中证A500指数增强<br>A | 博道中证A500指数增强<br>C |
|-------------------------------|-------------------|-------------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 323,558,174.79    | 257,191,485.82    |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 35,811,602.68     | 75,561,427.61     |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 44,142,066.82     | 108,424,901.44    |
| 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                   | 315,227,710.65    | 224,328,011.99    |

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

本基金管理人本报告期末未持有本基金。

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认购、申购、赎回、转换、红利再投、现金分红等。

§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中证A500指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》；

- 3、《博道中证A500指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道中证A500指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道中证A500指数增强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、报告期内博道中证A500指数增强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

2026年07月21日