

博道中证 A500 指数增强型证券投资基金

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:平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	47
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	67
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	67
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	67
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	67
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	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
7.12 投资组合报告附注	68
§8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69

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	70
§9 开放式基金份额变动	70
§10 重大事件揭示	71
10.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4 基金投资策略的改变	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	71
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	72
10.8 其他重大事件	73
§11 备查文件目录	74
11.1 备查文件目录	74
11.2 存放地点	74
11.3 查阅方式	74

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道中证A500指数增强型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	539,555,722.64份	
基金合同存续期	不定期	
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

2.2 基金产品说明

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。

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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛	潘琦
	联系电话	021-80226288	0755-22168257
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-085-2888	95511-3
传真		021-80226289	0755-82080387
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座
邮政编码		200122	518001
法定代表人		莫泰山	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.bdfund.cn
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博道基金管理有限公司	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日-2026年06月30日)	
	博道中证A500指数 增强A	博道中证A500指数 增强C
本期已实现收益	39,438,117.81	31,696,912.32
本期利润	58,901,479.93	48,643,244.10
加权平均基金份额本期利润	0.1889	0.1921
本期加权平均净值利润率	13.41%	13.74%
本期基金份额净值增长率	15.43%	15.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	132,117,252.85	92,163,115.53
期末可供分配基金份额利润	0.4191	0.4108
期末基金资产净值	481,587,377.24	340,759,152.32
期末基金份额净值	1.5277	1.5190
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	52.77%	51.90%

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

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	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%

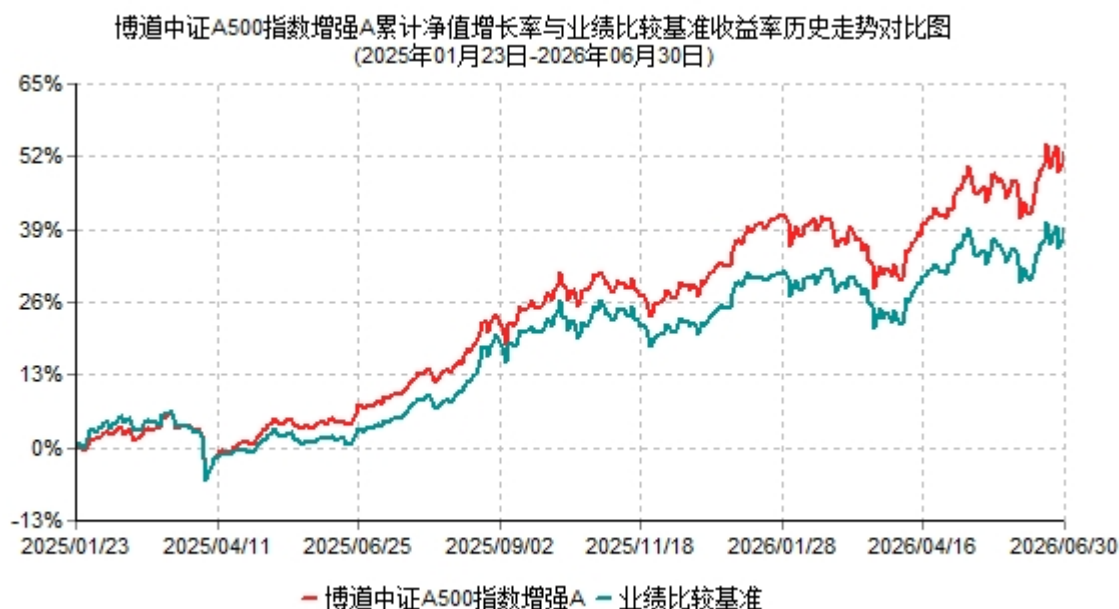
注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

博道中证A500指数增强C

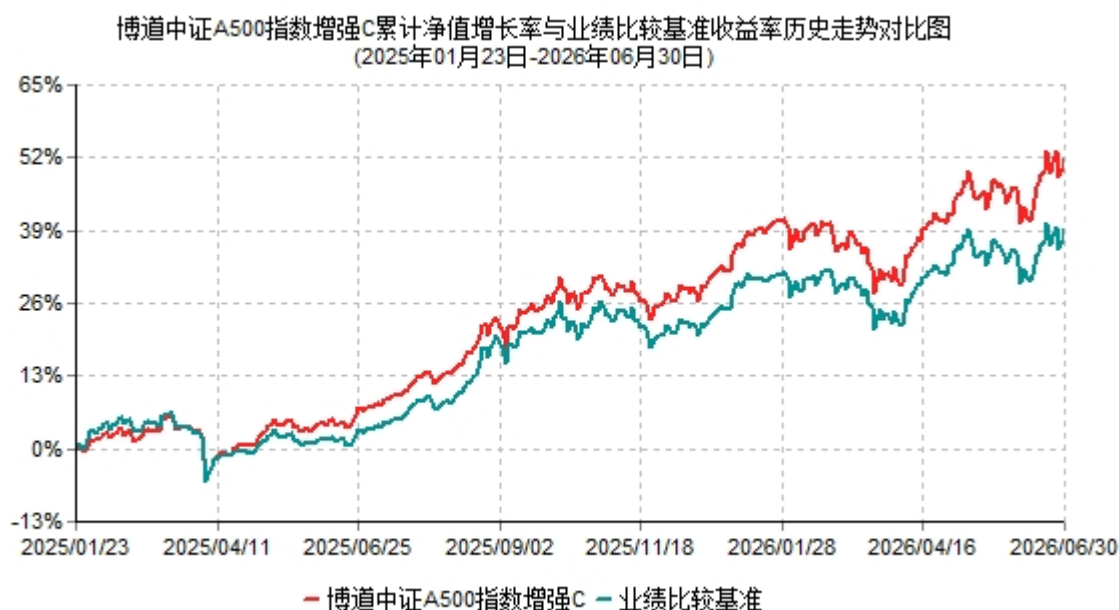
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	16.96%	1.39%	13.54%	1.34%	3.42%	0.05%
过去六个月	15.21%	1.28%	11.34%	1.22%	3.87%	0.06%
过去一年	41.51%	1.10%	34.41%	1.09%	7.10%	0.01%
自基金合同 生效起至今	51.90%	1.08%	39.13%	1.07%	12.77%	0.01%

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	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。

注：

1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等，本基金管理人未发现违反公平交易制度的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，本公司管理的所有投资组合参与交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况共发生4次，经检查未发现异常；本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026年上半年，受美以伊冲突、油价波动和流动性预期变化影响，全球市场剧烈震荡，风险偏好先抑后扬。A股主要宽基指数多数上涨，但结构分化明显，上证指数上涨3.16%，沪深300上涨7.55%，中证500上涨20.97%，中证1000上涨15.99%。风格上，中信成长风格指数上涨36.71%，中信周期风格指数下跌4.31%，中信消费风格指数下跌13.46%，中信金融风格指数下跌12.58%，中信稳定风格指数下跌6.36%。行业层面，电子、通信、建材涨幅居前，分别上涨85.49%、74.54%、43.70%，消费者服务、综合金融、综合跌幅较大，分别下跌31.88%、29.59%、25.09%。

从因子层面来看，表征景气度的基本面因子表现较好，价值类因子创下历史最大回撤，AI量价因子表现差异较大，部分因子策略捕捉到了较强的动量效应，部分因子策略偏量价反转逻辑。极致的抱团风格下，量化策略的环境并不友好。研究层面，博道量化团队继续围绕双均衡框架进行升级，以及推动组合优化与风控模块持续迭代。

报告期间，本基金维持配置中证A500多因子选股增强模型。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金份额净值及业绩表现请见"3.1 主要会计数据和财务指标"及"3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较"部分披露。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，主要宽基指数的预期盈利增速仍处于抬升阶段，预计市场重心将继续围绕基本面和产业趋势展开；对于量化产品而言，需重点关注三四季度动量反转的可能性并做好防范应对。

本基金将继续坚持系统化投资的运作思路，秉持勤勉尽责，力争为投资者获得有竞争力的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后，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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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：博道中证A500指数增强型证券投资基金
报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	15,748,402.19	12,028,687.22
结算备付金		1,025.27	1,019.84
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	807,266,409.88	620,447,143.88
其中：股票投资		766,316,479.86	587,477,134.79

基金投资		-	-
债券投资		40,949,930.02	32,970,009.09
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,000.00	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		13,799,905.33	35,741,888.22
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		836,817,742.67	668,218,739.16
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		9,369,906.30	17,599,824.00
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,298,080.56	4,482,954.13
应付管理人报酬		510,851.08	398,554.06
应付托管费		95,784.58	74,728.87
应付销售服务费		102,491.49	126,257.03
应付投资顾问费		-	-
应交税费		960.14	30.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	93,138.96	150,031.14

负债合计		14,471,213.11	22,832,379.79
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	539,555,722.64	488,691,845.78
未分配利润	6.4.7.7	282,790,806.92	156,694,513.59
净资产合计		822,346,529.56	645,386,359.37
负债和净资产总计		836,817,742.67	668,218,739.16

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：博道中证A500指数增强型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月23日（基金 合同生效日）至2025年 06月30日
一、营业总收入		112,071,932.85	28,353,346.60
1.利息收入		9,168.67	145,657.11
其中：存款利息收入	6.4.7.8	9,168.31	27,837.87
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		0.36	117,819.24
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		75,130,017.87	20,392,290.70
其中：股票投资收益	6.4.7.9	69,099,547.61	17,117,100.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	268,746.33	29,121.17
资产支持证券投资	6.4.7.11	-	-

收益			
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	5,761,723.93	3,246,069.22
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	36,409,693.90	7,562,672.94
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	523,052.41	252,725.85
减：二、营业总支出		4,527,208.82	2,265,401.38
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	3,145,010.83	1,456,544.73
2.托管费	6.4.10.2.2	589,689.46	273,102.07
3.销售服务费		704,894.88	464,856.92
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		7,885.05	165.34
其中：卖出回购金融资产支出		7,885.05	165.34
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		385.44	0.03
8.其他费用	6.4.7.16	79,343.16	70,732.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		107,544,724.03	26,087,945.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		107,544,724.03	26,087,945.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		107,544,724.03	26,087,945.22

6.3 净资产变动表

会计主体：博道中证A500指数增强型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	488,691,845.78	156,694,513.59	645,386,359.37
二、本期期初净资产	488,691,845.78	156,694,513.59	645,386,359.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	50,863,876.86	126,096,293.33	176,960,170.19
（一）、综合收益总额	-	107,544,724.03	107,544,724.03
（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）	50,863,876.86	18,551,569.30	69,415,446.16
其中：1.基金申购款	383,089,893.85	152,403,888.31	535,493,782.16
2.基金赎回款	-332,226,016.99	-133,852,319.01	-466,078,336.00
（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	539,555,722.64	282,790,806.92	822,346,529.56
项 目	上年度可比期间		
	2025年01月23日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	467,467,514.02	-	467,467,514.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-195,129,058.21	20,235,644.41	-174,893,413.80
（一）、综合收益总额	-	26,087,945.22	26,087,945.22
（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）	-195,129,058.21	-5,852,300.81	-200,981,359.02
其中：1.基金申购款	113,703,957.08	3,390,552.84	117,094,509.92
2.基金赎回款	-308,833,015.29	-9,242,853.65	-318,075,868.94
（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	272,338,455.81	20,235,644.41	292,574,100.22

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

博道中证A500指数增强型证券投资基金（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[2024]1594号《关于准予博道中证A500指数增强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《博道中证A500指数增强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467,337,175.54元，业经容诚会计师事务所（特殊普通合伙）容诚验字[2025]200Z0017号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》于2025年1月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为467,467,514.02份基金份额，其中认购资金利息折合130,338.48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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《博道中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》和《博道中证A500指数增强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；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的基金份额，称为C类基金份额。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《博道中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票（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）、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、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。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：本基金股票资产占基金资产的比例不低于90%，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%。每个交易日日终在扣除股指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。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为中证A500指数收益率 $\times 95\%$ +同期银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号--年度报告和中期报告》《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2026年01月01日至2026年06月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2026年06月30日的财务状况以及2026年01月01日至2026年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56号

《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027年12月31日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2027年12月31日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
----	--------------------

活期存款	531,998.36
等于：本金	531,938.41
加：应计利息	59.95
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	15,216,403.83
等于：本金	15,215,957.68
加：应计利息	446.15
减：坏账准备	-
合计	15,748,402.19

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		714,645,198.77	-	766,316,479.86	51,671,281.09
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	40,613,963.25	335,292.02	40,949,930.02	674.75
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	40,613,963.25	335,292.02	40,949,930.02	674.75
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	755,259,162.02	335,292.02	807,266,409.88	51,671,955.84

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,000.00	-

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	1,135.35
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	19,835.79

预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	12,660.45
合计	93,138.96

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 博道中证A500指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (博道中证A500指数增强A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	210,082,633.67	210,082,633.67
本期申购	188,997,577.06	188,997,577.06
本期赎回（以“-”号填列）	-83,852,500.08	-83,852,500.08
本期末	315,227,710.65	315,227,710.65

6.4.7.6.2 博道中证A500指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (博道中证A500指数增强C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	278,609,212.11	278,609,212.11
本期申购	194,092,316.79	194,092,316.79
本期赎回（以“-”号填列）	-248,373,516.91	-248,373,516.91
本期末	224,328,011.99	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。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 博道中证A500指数增强A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

(博道中证A500指数增强A)			
上年度末	60,399,405.12	7,555,112.47	67,954,517.59
本期期初	60,399,405.12	7,555,112.47	67,954,517.59
本期利润	39,438,117.81	19,463,362.12	58,901,479.93
本期基金份额交易产生的变动数	32,279,729.92	7,223,939.15	39,503,669.07
其中：基金申购款	61,703,859.49	12,733,280.86	74,437,140.35
基金赎回款	-29,424,129.57	-5,509,341.71	-34,933,471.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	132,117,252.85	34,242,413.74	166,359,666.59

6.4.7.7.2 博道中证A500指数增强C

单位：人民币元

项目 (博道中证A500指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	78,738,001.58	10,001,994.42	88,739,996.00
本期期初	78,738,001.58	10,001,994.42	88,739,996.00
本期利润	31,696,912.32	16,946,331.78	48,643,244.10
本期基金份额交易产生的变动数	-18,271,798.37	-2,680,301.40	-20,952,099.77
其中：基金申购款	67,662,363.91	10,304,384.05	77,966,747.96
基金赎回款	-85,934,162.28	-12,984,685.45	-98,918,847.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	92,163,115.53	24,268,024.80	116,431,140.33

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	1,501.83

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	7,661.05
结算备付金利息收入	5.43
其他	-
合计	9,168.31

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	4,025,560,067.23
减：卖出股票成本总额	3,952,381,722.58
减：交易费用	4,078,797.04
买卖股票差价收入	69,099,547.61

6.4.7.10 债券投资收益

6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	263,139.00
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,607.33
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	268,746.33

6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股	27,233,936.16

及债券到期兑付) 成交总额	
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	26,908,339.07
减：应计利息总额	319,986.16
减：交易费用	3.60
买卖债券差价收入	5,607.33

6.4.7.11 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	5,761,723.93
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,761,723.93

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	36,409,693.90
——股票投资	36,422,529.83
——债券投资	-12,835.93
——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	36,409,693.90

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	520,372.20
转换费收入	2,680.21
合计	523,052.41

注：

- 1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产；
 - 2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。
- 具体以本基金最新的招募说明书为准。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
合计	79,343.16

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
平安银行股份有限公司	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01月01日 至2026年06月30 日	上年度可比期间 2025年01月23日（基金合同 生效日）至2025年06月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,145,010.83	1,456,544.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	930,223.14	633,585.21
应支付基金管理人的净管理费	2,214,787.69	822,959.52

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日 至2026年06月30 日	上年度可比期间 2025年01月23日（基金合同生 效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	589,689.46	273,102.07

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01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道中证A500指数增强A	博道中证A500指数增强C	合计
博道基金 管理有限 公司	-	34,260.55	34,260.55
平安银行 股份有限	-	104,546.06	104,546.06

公司			
合计	-	138,806.61	138,806.61
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2025年01月23日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道中证A500指数增强A	博道中证A500指数增强C	合计
博道基金 管理有限 公司	-	9,367.17	9,367.17
平安银行 股份有限 公司	-	49,948.15	49,948.15
合计	-	59,315.32	59,315.32

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日基金销售服务费＝前一日C类基金份额对应的基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

于本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。（上年度末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0~10万份。）

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2026年01月01日至2026年06月30日		2025年01月23日（基金合同生效日） 至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行 股份有限 公司	531,998.36	1,501.83	921,483.26	7,125.89

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购 日	受限期	流通 受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 （单 位：股）	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
688008	澜起科技	2026-05-29	6个月	询价 转让 限售	250.08	276.82	30,000	7,502,400.00	8,304,600.00	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9个月	科创 板打 新限 售	104.66	768.89	1,464	153,222.24	1,125,654.96	-
688047	龙芯中科	2026-06-17	6个月	询价 转让 限售	120.00	139.86	5,000	600,000.00	699,300.00	-

300803	指南针	2026-04-24	6个月	询价转让限售	85.11	85.76	8,000	680,880.00	686,080.00	-
301666	大普微	2026-04-08	6个月	创业板打新限售	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
300724	捷佳伟创	2026-04-08	6个月	询价转让限售	94.12	66.40	7,000	658,840.00	464,800.00	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6个月	主板打新限售	10.11	10.11	26,532	268,238.52	268,238.52	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9个月	科创板打新限售	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	科创板打新限售	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	科创板打新限售	19.68	141.49	1,209	23,793.12	171,061.41	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	科创板打新限售	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6个月	主板打新限售	10.12	27.73	4,236	42,868.32	117,464.28	-
001248	华润	2026-06-2	1个月内	新股	10.11	10.11	11,370	114,950.70	114,950.70	-

	新能 源	4	(含)	未上 市						
3016 82	宏明 电子	2026 -03-1 8	6个月	创业 板打 新限 售	69.66	160.0 6	714	49,73 7.24	114,2 82.84	-
6887 97	臻宝 科技	2026 -06-1 6	6个月	科创 板打 新限 售	44.56	468.6 7	207	9,22 3.92	97,01 4.69	-
6887 12	北芯 生命	2026 -01-2 8	6个月	科创 板打 新限 售	17.52	35.92	1,500	26,28 0.00	53,88 0.00	-
6887 85	恒运 昌	2026 -01-2 0	6个月	科创 板打 新限 售	92.18	463.1 5	116	10,69 2.88	53,72 5.40	-
6888 13	泰金 新能	2026 -03-2 4	6个月	科创 板打 新限 售	26.28	172.0 9	234	6,14 9.52	40,26 9.06	-
6886 35	长进 光子	2026 -05-2 0	6个月	科创 板打 新限 售	40.98	308.1 9	128	5,24 5.44	39,44 8.32	-
0012 57	盛龙 股份	2026 -03-2 4	6个月	主板 打新 限售	7.82	20.74	1,743	13,63 0.26	36,14 9.82	-
6034 59	红板 科技	2026 -03-3 1	6个月	主板 打新 限售	17.70	84.32	330	5,84 1.00	27,82 5.60	-
0013 65	天海	2026 -05-1	6个月	主板	27.19	31.31	719	19,54 9.61	22,51 1.89	-

	电子	1		打新 限售						
6888 11	有研 复材	2026 -04-0 1	6个月	科创 板打 新限 售	6.41	24.13	834	5,34 5.94	20,12 4.42	-
3016 96	三瑞 智能	2026 -03-3 1	6个月	创业 板打 新限 售	24.68	86.80	216	5,33 0.88	18,74 8.80	-
0012 37	惠康 科技	2026 -05-1 5	6个月	主板 打新 限售	53.26	58.74	285	15,17 9.10	16,74 0.90	-
3016 69	高特 电子	2026 -06-0 2	6个月	创业 板打 新限 售	7.08	28.40	546	3,86 5.68	15,50 6.40	-
3016 87	新广 益	2025 -12-2 4	6个月	创业 板打 新限 售	21.93	77.78	195	4,27 6.35	15,16 7.10	-
0013 93	维通 利	2026 -05-0 8	6个月	主板 打新 限售	30.38	38.99	387	11,75 7.06	15,08 9.13	-
3015 31	春光 集团	2026 -04-2 8	6个月	创业 板打 新限 售	13.30	51.56	290	3,85 7.00	14,95 2.40	-
3015 99	理奇 智能	2026 -04-2 2	6个月	创业 板打 新限 售	13.91	32.47	433	6,02 3.03	14,05 9.51	-
3016 80	固德	2026 -02-2	6个月	创业	58.00	112.1 6	117	6,78 6.00	13,12 2.72	-

	电材	7		板打 新限售						
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月	创业板打 新限售	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	主板打 新限售	11.18	17.59	650	7,267.00	11,433.50	-
688816	易思维	2026-02-04	6个月	科创板打 新限售	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	主板打 新限售	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6个月	创业板打 新限售	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	主板打 新限售	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月	主板打 新限售	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	主板打 新限售	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月	主板打 新限售	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-

603284	林平发展	2026-02-03	6个月	主板打新限售	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6个月	主板打新限售	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的解限日和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2026年06月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额9,369,906.30元，截至2026年7月1日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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平安银行，其他存款存放于山西证券股份有限公司

司、中信证券华南股份有限公司、中信证券股份有限公司和方正证券股份有限公司，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，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2025年12月31日：同)。

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，除卖出回购金融资产款余额中有9,369,906.30元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流

通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2026年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为1.69%。

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818,660,305.15元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资和买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	15,748,402.19	-	-	-	-	-	15,748,402.19
结算备付金	1,025.27	-	-	-	-	-	1,025.27
交易性金融资产	11,128,754.02	-	29,821,176.00	-	-	766,316,479.86	807,266,409.88
买入返售金融资产	2,000.00	-	-	-	-	-	2,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-	13,799,905.33	13,799,905.33
资产总计	26,880,181.48	-	29,821,176.00	-	-	780,116,385.19	836,817,742.67
负债							
卖出回购金融资产款	9,369,906.30	-	-	-	-	-	9,369,906.30
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,298,080.56	4,298,080.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	510,851.08	510,851.08
应付托管费	-	-	-	-	-	95,784.58	95,784.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-	102,491.49	102,491.49
应交税费	-	-	-	-	-	960.14	960.14
其他负债	-	-	-	-	-	93,138.96	93,138.96
负债总计	9,369,906.30	-	-	-	-	5,101,306.81	14,471,213.11

计							
利率敏感度缺口	17,510,275.18	-	29,821,176.00	-	-	775,015,078.38	822,346,529.56
上年度末 2025年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	12,028,687.22	-	-	-	-	-	12,028,687.22
结算备付金	1,019.84	-	-	-	-	-	1,019.84
交易性金融资产	606,693.04	-	32,363,316.05	-	-	587,477,134.79	620,447,143.88
应收申购款	-	-	-	-	-	35,741,888.22	35,741,888.22
资产总计	12,636,400.10	-	32,363,316.05	-	-	623,219,023.01	668,218,739.16
负债							
卖出回购金融资产款	17,599,824.00	-	-	-	-	-	17,599,824.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,482,954.13	4,482,954.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	398,554.06	398,554.06
应付托管费	-	-	-	-	-	74,728.87	74,728.87
应付销售服务费	-	-	-	-	-	126,257.03	126,257.03
应交税费	-	-	-	-	-	30.56	30.56
其他负债	-	-	-	-	-	150,031.14	150,031.14
负债总计	17,599,824.00	-	-	-	-	5,232,555.79	22,832,379.79
利率敏	-4,963,423.90	-	32,363,316.05	-	-	617,986,467.22	645,386,359.37

敏感度缺口							
-------	--	--	--	--	--	--	--

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2026年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为4.98%(2025年12月31日：5.11%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2025年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金主要投资于股票，股票资产在基金资产的比例不低于90%，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%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，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、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	766,316,479.86	93.19	587,477,134.79	91.03
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	766,316,479.86	93.19	587,477,134.79	91.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证A500指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	1.中证A500指数收益率上升5%	49,257,993.79	33,472,400.19
	2.中证A500指数收益率下降5%	-49,257,993.79	-33,472,400.19

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	752,458,766.96	581,496,951.06
第二层次	41,333,119.24	33,632,013.09
第三层次	13,474,523.68	5,318,179.73
合计	807,266,409.88	620,447,143.88

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
----	----	----	--------------

1	权益投资	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：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,749,427.46	1.88
8	其他各项资产	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。

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（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、环境和公共设施管理业	2,207,172.00	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
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

7.2.2 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、仓储和邮政业	384,873.46	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,100,512.00	0.13
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、环境和公共设施管理业	3,309,791.00	0.40
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	97,513,312.59	11.86

7.2.3 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

7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	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
11	688981	中芯国际	65,315	10,373,328.30	1.26
12	600030	中信证券	353,800	10,164,674.00	1.24
13	000333	美的集团	129,960	9,815,878.80	1.19

14	688008	澜起科技	30,000	8,304,600.00	1.01
15	688041	海光信息	22,220	8,228,066.00	1.00
16	601899	紫金矿业	322,800	8,115,192.00	0.99
17	603259	药明康德	62,500	7,781,875.00	0.95
18	002415	海康威视	208,300	7,123,860.00	0.87
19	300604	长川科技	20,800	7,101,536.00	0.86
20	601398	工商银行	995,000	7,034,650.00	0.86
21	603993	洛阳钼业	382,200	6,707,610.00	0.82
22	601166	兴业银行	392,700	6,503,112.00	0.79
23	002916	深南电路	14,100	6,456,390.00	0.79
24	002281	光迅科技	24,100	6,192,254.00	0.75
25	601628	中国人寿	174,218	6,158,606.30	0.75
26	688012	中微公司	12,748	5,972,438.00	0.73
27	002371	北方华创	6,600	5,838,096.00	0.71
28	300475	香农芯创	18,200	5,460,000.00	0.66
29	002594	比亚迪	68,500	5,459,450.00	0.66
30	000657	中钨高新	56,100	5,369,892.00	0.65
31	601988	中国银行	927,200	5,303,584.00	0.64
32	002600	领益智造	298,602	5,177,758.68	0.63
33	000425	徐工机械	619,700	5,013,373.00	0.61
34	300450	先导智能	120,700	4,914,904.00	0.60
35	300014	亿纬锂能	75,500	4,909,765.00	0.60
36	601288	农业银行	805,100	4,886,957.00	0.59
37	301308	江波龙	6,900	4,856,220.00	0.59
38	002156	通富微电	64,000	4,855,680.00	0.59
39	603799	华友钴业	98,000	4,729,480.00	0.58
40	688235	百济神州	18,350	4,672,093.50	0.57
41	300760	迈瑞医疗	33,500	4,550,305.00	0.55
42	300033	同花顺	18,800	4,530,800.00	0.55
43	002851	麦格米特	27,100	4,530,578.00	0.55
44	600309	万华化学	65,650	4,491,116.50	0.55

45	300661	圣邦股份	31,200	4,476,576.00	0.54
46	300803	指南针	49,300	4,472,051.00	0.54
47	002938	鹏鼎控股	41,400	4,362,732.00	0.53
48	300857	协创数据	12,720	4,323,528.00	0.53
49	300408	三环集团	25,900	4,322,710.00	0.53
50	600487	亨通光电	39,000	4,264,260.00	0.52
51	600900	长江电力	159,900	4,232,553.00	0.51
52	601211	国泰海通	232,100	4,224,220.00	0.51
53	605117	德业股份	39,180	4,160,132.40	0.51
54	300073	当升科技	86,300	4,145,852.00	0.50
55	300059	东方财富	202,500	4,126,950.00	0.50
56	002049	紫光国微	44,900	3,984,875.00	0.48
57	603019	中科曙光	37,100	3,978,233.00	0.48
58	002080	中材科技	42,300	3,807,000.00	0.46
59	000858	五粮液	51,400	3,803,600.00	0.46
60	600938	中国海油	137,200	3,724,980.00	0.45
61	600875	东方电气	126,200	3,630,774.00	0.44
62	000725	京东方 A	413,000	3,584,840.00	0.44
63	688525	佰维存储	7,200	3,562,056.00	0.43
64	002517	恺英网络	217,600	3,536,000.00	0.43
65	600460	士兰微	62,600	3,421,716.00	0.42
66	600547	山东黄金	145,900	3,368,831.00	0.41
67	601328	交通银行	523,200	3,364,176.00	0.41
68	600183	生益科技	19,400	3,363,960.00	0.41
69	000426	兴业银锡	100,800	3,322,368.00	0.40
70	600392	盛和资源	107,300	3,194,321.00	0.39
71	600176	中国巨石	43,800	3,192,144.00	0.39
72	000100	TCL科技	537,200	3,126,504.00	0.38
73	601127	赛力斯	50,300	3,080,875.00	0.37
74	002064	华峰化学	323,000	3,065,270.00	0.37
75	600115	中国东航	794,238	3,026,046.78	0.37

76	600233	圆通速递	189,100	2,978,325.00	0.36
77	601857	中国石油	337,500	2,929,500.00	0.36
78	000408	藏格矿业	42,000	2,911,440.00	0.35
79	600150	中国船舶	85,700	2,895,803.00	0.35
80	600028	中国石化	647,900	2,889,634.00	0.35
81	300124	汇川技术	41,600	2,759,328.00	0.34
82	600276	恒瑞医药	52,400	2,726,896.00	0.33
83	300054	鼎龙股份	25,700	2,723,429.00	0.33
84	002714	牧原股份	77,600	2,715,224.00	0.33
85	688390	固德威	24,907	2,702,658.57	0.33
86	001965	招商公路	290,600	2,661,896.00	0.32
87	601600	中国铝业	321,100	2,639,442.00	0.32
88	600816	建元信托	1,018,900	2,486,116.00	0.30
89	600690	海尔智家	119,900	2,447,159.00	0.30
90	002648	卫星化学	104,000	2,442,960.00	0.30
91	688266	泽璟制药	20,754	2,421,161.64	0.29
92	688347	华虹宏力	7,000	2,354,100.00	0.29
93	600887	伊利股份	97,400	2,333,704.00	0.28
94	000034	神州数码	84,000	2,331,000.00	0.28
95	002352	顺丰控股	73,700	2,303,862.00	0.28
96	002028	思源电气	12,900	2,231,700.00	0.27
97	002266	浙富控股	436,200	2,207,172.00	0.27
98	002120	韵达股份	346,600	2,204,376.00	0.27
99	002602	世纪华通	154,100	2,172,810.00	0.26
100	688002	睿创微纳	13,880	2,147,097.20	0.26
101	002001	新 和 成	75,000	2,131,500.00	0.26
102	300409	道氏技术	106,000	2,112,580.00	0.26
103	600941	中国移动	23,700	2,041,281.00	0.25
104	300223	北京君正	8,100	2,016,090.00	0.25
105	300748	金力永磁	64,100	1,977,485.00	0.24
106	300058	蓝色光标	143,600	1,975,936.00	0.24

107	002558	巨人网络	71,600	1,973,296.00	0.24
108	601168	西部矿业	68,300	1,853,662.00	0.23
109	300115	长盈精密	64,000	1,788,160.00	0.22
110	600879	航天电子	82,500	1,756,425.00	0.21
111	600031	三一重工	100,050	1,728,864.00	0.21
112	600219	南山铝业	424,000	1,691,760.00	0.21
113	000977	浪潮信息	23,900	1,673,000.00	0.20
114	301358	湖南裕能	22,000	1,669,140.00	0.20
115	000157	中联重科	235,500	1,641,435.00	0.20
116	002025	航天电器	21,500	1,638,730.00	0.20
117	300274	阳光电源	10,000	1,590,200.00	0.19
118	300342	天银机电	33,800	1,588,600.00	0.19
119	300442	润泽科技	18,600	1,545,102.00	0.19
120	002271	东方雨虹	130,000	1,543,100.00	0.19
121	600482	中国动力	45,100	1,479,280.00	0.18
122	300458	全志科技	36,860	1,454,495.60	0.18
123	300919	中伟新材	32,200	1,408,750.00	0.17
124	601872	招商轮船	74,600	1,310,722.00	0.16
125	300724	捷佳伟创	18,600	1,283,760.00	0.16
126	003816	中国广核	323,800	1,266,058.00	0.15
127	300896	爱美客	14,500	1,264,400.00	0.15
128	300476	胜宏科技	3,500	1,212,505.00	0.15
129	601728	中国电信	232,700	1,207,713.00	0.15
130	300567	精测电子	3,800	1,206,880.00	0.15
131	000960	锡业股份	28,100	1,199,589.00	0.15
132	002202	金风科技	49,300	1,178,270.00	0.14
133	002241	歌尔股份	52,100	1,173,813.00	0.14
134	300017	网宿科技	89,100	1,159,191.00	0.14
135	002463	沪电股份	7,000	1,069,600.00	0.13
136	002294	信立泰	32,800	1,045,992.00	0.13
137	601088	中国神华	25,000	976,000.00	0.12

138	300015	爱尔眼科	117,500	970,550.00	0.12
139	000651	格力电器	25,600	960,000.00	0.12
140	002603	以岭药业	63,900	958,500.00	0.12
141	002236	大华股份	56,300	928,387.00	0.11
142	300454	深信服	9,500	913,900.00	0.11
143	600893	航发动力	23,400	897,156.00	0.11
144	300049	福瑞医科	22,800	886,464.00	0.11
145	600549	厦门钨业	10,300	877,560.00	0.11
146	300432	富临精工	43,500	873,915.00	0.11
147	600989	宝丰能源	41,100	835,563.00	0.10
148	300394	天孚通信	2,760	835,396.80	0.10
149	605499	东鹏饮料	6,610	815,872.30	0.10
150	600089	特变电工	35,900	807,750.00	0.10
151	601233	桐昆股份	37,100	803,215.00	0.10
152	002179	中航光电	16,900	780,780.00	0.09
153	000786	北新建材	42,900	776,061.00	0.09
154	600362	江西铜业	17,700	766,410.00	0.09
155	002837	英维克	9,420	749,455.20	0.09
156	603659	璞泰来	25,000	723,250.00	0.09
157	601658	邮储银行	146,600	722,738.00	0.09
158	601888	中国中免	13,400	719,714.00	0.09
159	002493	荣盛石化	65,400	703,050.00	0.09
160	688047	龙芯中科	5,000	699,300.00	0.09
161	600570	恒生电子	32,100	680,199.00	0.08
162	603486	科沃斯	13,200	669,900.00	0.08
163	300677	英科医疗	17,100	669,807.00	0.08
164	300438	鹏辉能源	7,800	646,230.00	0.08
165	600660	福耀玻璃	12,600	635,544.00	0.08
166	000975	山金国际	37,000	629,000.00	0.08
167	000792	盐湖股份	19,400	585,686.00	0.07
168	600489	中金黄金	32,300	583,015.00	0.07

169	002532	天山铝业	51,900	556,887.00	0.07
170	000066	中国长城	27,800	529,590.00	0.06
171	600406	国电南瑞	22,500	514,125.00	0.06
172	300339	润和软件	13,100	504,481.00	0.06
173	603806	福斯特	29,800	500,342.00	0.06
174	000617	中油资本	75,400	496,886.00	0.06
175	000625	长安汽车	66,300	475,371.00	0.06
176	601225	陕西煤业	23,000	468,050.00	0.06
177	300751	迈为股份	1,600	451,936.00	0.05
178	000400	许继电气	19,100	414,470.00	0.05
179	000932	华菱钢铁	118,900	412,583.00	0.05
180	000988	华工科技	2,200	406,142.00	0.05
181	002738	中矿资源	6,800	401,132.00	0.05
182	002891	中宠股份	15,000	400,800.00	0.05
183	002008	大族激光	2,600	390,286.00	0.05
184	600000	浦发银行	44,700	384,867.00	0.05
185	600499	科达制造	27,800	383,640.00	0.05
186	002432	九安医疗	5,100	360,468.00	0.04
187	600050	中国联通	86,500	346,000.00	0.04
188	002812	恩捷股份	5,100	341,241.00	0.04
189	002460	赣锋锂业	4,700	307,380.00	0.04
190	600196	复星医药	13,400	301,098.00	0.04
191	600699	均胜电子	13,700	296,057.00	0.04
192	300395	菲利华	2,200	294,206.00	0.04
193	000831	中国稀土	5,300	294,097.00	0.04
194	002155	湖南黄金	12,300	293,601.00	0.04
195	600312	平高电气	16,100	284,326.00	0.03
196	002821	凯莱英	1,700	275,400.00	0.03
197	301550	斯菱智驱	3,000	274,290.00	0.03
198	002050	三花智控	6,100	267,363.00	0.03
199	000338	潍柴动力	9,800	267,050.00	0.03

200	002625	光启技术	8,800	266,816.00	0.03
201	000878	云南铜业	15,900	252,492.00	0.03
202	601058	赛轮轮胎	21,700	250,201.00	0.03
203	300142	沃森生物	18,500	240,315.00	0.03
204	601816	京沪高铁	51,800	234,654.00	0.03
205	688608	恒玄科技	1,400	234,066.00	0.03
206	302132	中航成飞	4,000	233,280.00	0.03
207	000967	盈峰环境	21,700	228,501.00	0.03
208	300136	信维通信	1,900	226,575.00	0.03
209	601615	明阳智能	19,300	223,301.00	0.03
210	688111	金山办公	1,000	213,050.00	0.03
211	600039	四川路桥	25,400	198,628.00	0.02
212	002130	沃尔核材	10,200	193,392.00	0.02
213	000630	铜陵有色	29,700	188,892.00	0.02
214	002407	多氟多	3,700	185,851.00	0.02
215	002389	航天彩虹	10,300	183,031.00	0.02
216	601155	新城控股	15,300	156,978.00	0.02
217	002244	滨江集团	20,000	152,000.00	0.02
218	688169	石头科技	1,600	151,952.00	0.02
219	688122	西部超导	2,400	150,744.00	0.02
220	600585	海螺水泥	8,600	145,770.00	0.02
221	600886	国投电力	10,400	138,424.00	0.02
222	600415	小商品城	13,600	138,176.00	0.02
223	000933	神火股份	6,400	135,680.00	0.02
224	600673	东阳光	4,000	134,320.00	0.02
225	000568	泸州老窖	1,600	124,032.00	0.02
226	688099	晶晨股份	1,200	123,480.00	0.02
227	002756	永兴材料	2,100	118,944.00	0.01
228	000738	航发控制	6,400	117,056.00	0.01
229	600372	中航机载	10,700	116,095.00	0.01
230	001979	招商蛇口	17,000	109,310.00	0.01

231	601633	长城汽车	6,400	96,576.00	0.01
232	000683	博源化工	16,300	93,888.00	0.01
233	600096	云天化	3,000	91,200.00	0.01
234	600760	中航沈飞	2,200	90,420.00	0.01
235	300390	天华新能	900	84,159.00	0.01
236	600258	首旅酒店	7,400	80,808.00	0.01

7.3.2 期末积极投资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	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
6	600999	招商证券	127,500	2,690,250.00	0.33
7	603083	剑桥科技	10,400	2,650,648.00	0.32
8	001309	德明利	2,600	2,451,540.00	0.30
9	603588	高能环境	124,900	2,398,080.00	0.29
10	603516	淳中科技	17,600	2,369,136.00	0.29
11	000534	万泽股份	81,500	2,229,840.00	0.27
12	002328	新朋股份	301,600	2,213,744.00	0.27
13	601138	工业富联	28,000	2,020,200.00	0.25
14	688766	普冉股份	2,594	1,988,560.40	0.24
15	600498	烽火通信	26,500	1,950,400.00	0.24
16	300121	阳谷华泰	147,500	1,858,500.00	0.23
17	688353	华盛锂电	16,000	1,857,120.00	0.23
18	300164	通源石油	226,100	1,808,800.00	0.22
19	300416	苏试试验	84,900	1,730,262.00	0.21

20	301150	中一科技	24,280	1,532,310.80	0.19
21	603228	景旺电子	20,200	1,462,682.00	0.18
22	301377	鼎泰高科	2,600	1,432,340.00	0.17
23	002979	雷赛智能	22,900	1,277,362.00	0.16
24	688378	奥来德	20,400	1,264,800.00	0.15
25	688531	日联科技	7,000	1,244,880.00	0.15
26	002379	宏桥控股	82,900	1,224,433.00	0.15
27	688802	沐曦股份	1,464	1,125,654.96	0.14
28	601101	昊华能源	101,600	1,072,896.00	0.13
29	600903	贵州燃气	156,700	1,040,488.00	0.13
30	002636	金安国纪	8,500	1,019,745.00	0.12
31	300839	博汇股份	84,700	991,837.00	0.12
32	603067	振华股份	20,500	948,945.00	0.12
33	603798	康普顿	68,800	941,184.00	0.11
34	002498	汉缆股份	137,600	938,432.00	0.11
35	300628	亿联网络	25,695	869,004.90	0.11
36	300335	迪森股份	161,900	788,453.00	0.10
37	300774	倍杰特	66,500	714,875.00	0.09
38	688639	华恒生物	43,000	694,020.00	0.08
39	300277	汽轮科技	45,500	684,320.00	0.08
40	600809	山西汾酒	5,900	645,283.00	0.08
41	300758	七彩化学	50,100	628,755.00	0.08
42	300870	欧陆通	1,800	622,242.00	0.08
43	688516	奥特维	10,700	614,073.00	0.07
44	605196	华通线缆	23,400	610,740.00	0.07
45	300986	志特新材	34,700	595,105.00	0.07
46	000987	越秀资本	74,000	578,680.00	0.07
47	300590	移为通信	40,300	578,305.00	0.07
48	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.07
49	300102	乾照光电	21,200	552,048.00	0.07
50	601606	长城军工	20,000	549,800.00	0.07

51	301039	中集车辆	76,000	535,800.00	0.07
52	603893	瑞芯微	2,800	527,408.00	0.06
53	301369	联动科技	2,100	514,500.00	0.06
54	603061	金海通	1,000	502,220.00	0.06
55	300638	广和通	25,500	472,005.00	0.06
56	603296	华勤技术	6,200	460,474.00	0.06
57	300893	松原安全	28,100	455,220.00	0.06
58	600502	安徽建工	102,600	446,310.00	0.05
59	002792	通宇通讯	11,500	409,055.00	0.05
60	688388	嘉元科技	9,290	408,760.00	0.05
61	603093	南华期货	22,300	404,745.00	0.05
62	002662	峰璟股份	104,200	385,540.00	0.05
63	002402	和而泰	14,900	384,867.00	0.05
64	001248	华润新能源	37,902	383,189.22	0.05
65	002404	嘉欣丝绸	64,500	368,940.00	0.04
66	000559	万向钱潮	28,300	365,919.00	0.04
67	000949	新乡化纤	57,400	363,916.00	0.04
68	002534	西子洁能	19,300	358,015.00	0.04
69	301086	鸿富瀚	1,700	355,776.00	0.04
70	000533	顺钠股份	36,800	349,968.00	0.04
71	603101	汇嘉时代	53,400	333,216.00	0.04
72	002643	万润股份	15,900	333,105.00	0.04
73	601869	长飞光纤	600	327,540.00	0.04
74	300979	华利集团	10,700	318,325.00	0.04
75	300129	泰胜风能	36,900	315,495.00	0.04
76	688697	纽威数控	23,064	313,439.76	0.04
77	300004	南风股份	30,200	305,020.00	0.04
78	002947	恒铭达	4,000	304,200.00	0.04
79	300988	津荣天宇	18,840	294,469.20	0.04
80	000981	山子高科	99,000	285,120.00	0.03
81	301529	福赛科技	2,900	279,444.00	0.03

82	002645	华宏科技	9,760	268,497.60	0.03
83	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.03
84	002676	顺威股份	53,500	266,430.00	0.03
85	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.03
86	603871	嘉友国际	24,600	251,166.00	0.03
87	688358	祥生医疗	8,200	250,674.00	0.03
88	000969	安泰科技	9,800	240,492.00	0.03
89	688221	前沿生物	10,514	235,513.60	0.03
90	001339	智微智能	2,150	219,902.00	0.03
91	300322	硕贝德	8,400	211,680.00	0.03
92	688523	航天环宇	4,000	209,600.00	0.03
93	002887	绿茵生态	18,800	196,836.00	0.02
94	603268	松发股份	1,400	194,992.00	0.02
95	601939	建设银行	19,700	189,711.00	0.02
96	002990	盛视科技	2,400	189,600.00	0.02
97	688108	赛诺医疗	10,111	187,356.83	0.02
98	688385	复旦微电	2,600	185,354.00	0.02
99	688717	艾罗能源	2,200	181,654.00	0.02
100	688159	有方科技	4,000	177,560.00	0.02
101	002859	洁美科技	1,600	175,216.00	0.02
102	000506	招金黄金	14,800	173,456.00	0.02
103	300804	广康生化	5,500	171,930.00	0.02
104	688820	盛合晶微	1,209	171,061.41	0.02
105	300658	延江股份	14,700	168,021.00	0.02
106	300548	长芯博创	600	166,800.00	0.02
107	002470	金正大	82,300	166,246.00	0.02
108	002943	宇晶股份	3,620	160,112.60	0.02
109	300473	德尔股份	5,100	155,040.00	0.02
110	002396	星网锐捷	8,000	153,360.00	0.02
111	600236	桂冠电力	17,400	152,772.00	0.02
112	301127	武汉天源	7,200	149,184.00	0.02

113	300191	潜能恒信	5,300	146,545.00	0.02
114	688536	思瑞浦	400	145,636.00	0.02
115	603933	睿能科技	6,100	137,555.00	0.02
116	601995	中金公司	3,800	137,370.00	0.02
117	000811	冰轮环境	2,400	134,928.00	0.02
118	300791	仙乐健康	8,300	132,966.00	0.02
119	001872	招商港口	6,800	132,124.00	0.02
120	300715	凯伦股份	7,900	130,034.00	0.02
121	300401	花园生物	5,900	129,151.00	0.02
122	600546	山煤国际	11,800	128,974.00	0.02
123	300456	赛微电子	3,000	127,410.00	0.02
124	000919	金陵药业	21,200	123,596.00	0.02
125	000895	双汇发展	5,500	123,200.00	0.01
126	002476	新叶股份	24,800	120,528.00	0.01
127	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
128	300775	三角防务	5,400	119,016.00	0.01
129	001399	惠科股份	4,236	117,464.28	0.01
130	300681	英搏尔	4,100	117,342.00	0.01
131	300279	和晶科技	19,300	116,765.00	0.01
132	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
133	600742	富维股份	15,600	112,944.00	0.01
134	603737	三棵树	4,500	108,450.00	0.01
135	600970	中材国际	14,800	105,524.00	0.01
136	002749	国光股份	13,100	104,538.00	0.01
137	600722	金牛化工	12,700	103,124.00	0.01
138	300139	晓程科技	2,800	102,340.00	0.01
139	600105	永鼎股份	1,500	101,220.00	0.01
140	688027	国盾量子	200	100,802.00	0.01
141	003018	金富科技	1,300	99,099.00	0.01
142	600583	海油工程	19,400	97,582.00	0.01
143	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01

144	000901	航天科技	4,900	87,171.00	0.01
145	600188	兖矿能源	4,900	87,073.00	0.01
146	300905	宝丽迪	1,700	86,020.00	0.01
147	688261	东微半导	800	83,944.00	0.01
148	002683	广东宏大	2,800	82,012.00	0.01
149	300349	金卡智能	7,400	80,956.00	0.01
150	600590	泰豪科技	8,000	80,800.00	0.01
151	601898	中煤能源	6,600	80,388.00	0.01
152	002703	浙江世宝	5,600	79,688.00	0.01
153	300864	南大环境	4,100	78,638.00	0.01
154	002282	博深股份	13,900	78,257.00	0.01
155	000030	富奥股份	20,200	78,174.00	0.01
156	000927	中国铁物	34,400	78,088.00	0.01
157	300666	江丰电子	200	73,720.00	0.01
158	600605	汇通能源	2,500	72,300.00	0.01
159	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
160	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
161	002931	锋龙股份	700	48,286.00	0.01
162	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
163	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
164	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
165	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
166	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
167	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
168	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
169	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
170	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
171	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
172	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
173	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
174	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00

175	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
176	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
177	601112	振石股份	650	11,433.50	0.00
178	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
179	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
180	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
181	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
182	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
183	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
184	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
185	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
186	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688008	澜起科技	34,352,780.66	5.32
2	601601	中国太保	33,882,564.00	5.25
3	300502	新易盛	32,210,629.00	4.99
4	300308	中际旭创	30,350,290.00	4.70
5	601628	中国人寿	30,118,094.52	4.67
6	300750	宁德时代	29,060,766.00	4.50
7	300274	阳光电源	27,844,453.00	4.31
8	002281	光迅科技	26,771,737.48	4.15
9	600150	中国船舶	25,537,144.94	3.96
10	688041	海光信息	24,922,663.63	3.86
11	688256	寒武纪	24,152,991.74	3.74
12	300604	长川科技	23,100,528.00	3.58

13	688390	固德威	22,443,663.92	3.48
14	603993	洛阳钼业	22,100,718.00	3.42
15	600519	贵州茅台	21,555,152.80	3.34
16	000426	兴业银锡	21,378,878.00	3.31
17	600036	招商银行	20,834,224.00	3.23
18	688012	中微公司	20,581,447.85	3.19
19	601899	紫金矿业	20,191,124.00	3.13
20	600183	生益科技	20,090,637.50	3.11
21	603986	兆易创新	20,085,394.00	3.11
22	002851	麦格米特	19,571,551.83	3.03
23	000725	京东方 A	19,486,995.00	3.02
24	688981	中芯国际	19,477,768.97	3.02
25	300476	胜宏科技	19,233,396.00	2.98
26	002558	巨人网络	19,115,815.00	2.96
27	300059	东方财富	18,428,975.00	2.86
28	603799	华友钴业	18,242,895.00	2.83
29	000651	格力电器	18,089,495.00	2.80
30	002475	立讯精密	17,982,101.00	2.79
31	600031	三一重工	17,683,335.50	2.74
32	600030	中信证券	17,461,344.00	2.71
33	002594	比亚迪	17,285,288.00	2.68
34	300014	亿纬锂能	17,258,683.00	2.67
35	600887	伊利股份	17,232,679.00	2.67
36	601166	兴业银行	17,195,104.00	2.66
37	301358	湖南裕能	17,084,703.00	2.65
38	002463	沪电股份	17,066,081.00	2.64
39	002008	大族激光	16,955,649.00	2.63
40	300450	先导智能	16,787,957.00	2.60
41	002155	湖南黄金	16,681,724.00	2.58
42	601872	招商轮船	16,521,740.00	2.56
43	601138	工业富联	16,446,555.00	2.55

44	000792	盐湖股份	16,437,129.00	2.55
45	600549	厦门钨业	16,357,131.00	2.53
46	300442	润泽科技	16,171,751.00	2.51
47	300124	汇川技术	16,103,881.00	2.50
48	000988	华工科技	16,092,220.53	2.49
49	601857	中国石油	15,703,348.00	2.43
50	000333	美的集团	15,611,629.40	2.42
51	002497	雅化集团	15,597,827.00	2.42
52	601211	国泰海通	15,258,343.00	2.36
53	601398	工商银行	15,055,074.00	2.33
54	000425	徐工机械	14,819,222.00	2.30
55	600900	长江电力	14,747,502.00	2.29
56	600487	亨通光电	14,658,849.00	2.27
57	300033	同花顺	14,277,135.12	2.21
58	600938	中国海油	14,222,809.00	2.20
59	300454	深信服	14,062,070.70	2.18
60	603920	世运电路	13,968,783.00	2.16
61	600111	北方稀土	13,837,776.00	2.14
62	000657	中钨高新	13,833,167.00	2.14
63	002049	紫光国微	13,791,464.00	2.14
64	301308	江波龙	13,788,171.00	2.14
65	000063	中兴通讯	13,767,875.00	2.13
66	601088	中国神华	13,730,912.00	2.13
67	002384	东山精密	13,691,648.00	2.12
68	600392	盛和资源	13,691,331.00	2.12
69	600276	恒瑞医药	13,625,514.00	2.11
70	300136	信维通信	13,356,042.00	2.07
71	002517	恺英网络	13,296,583.00	2.06
72	002916	深南电路	13,275,401.00	2.06
73	600816	建元信托	13,086,806.00	2.03
74	002415	海康威视	13,025,960.00	2.02

75	688002	睿创微纳	13,003,602.24	2.01
76	000408	藏格矿业	12,934,630.00	2.00
77	002156	通富微电	12,913,364.00	2.00
78	688111	金山办公	12,912,857.58	2.00

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688008	澜起科技	36,212,946.65	5.61
2	300502	新易盛	32,751,309.00	5.07
3	601601	中国太保	31,825,909.00	4.93
4	002281	光迅科技	31,557,227.00	4.89
5	300274	阳光电源	28,925,683.00	4.48
6	002008	大族激光	28,819,605.00	4.47
7	601899	紫金矿业	27,315,063.00	4.23
8	688390	固德威	26,352,492.84	4.08
9	300604	长川科技	25,770,416.00	3.99
10	603993	洛阳钼业	25,095,428.00	3.89
11	300750	宁德时代	24,689,521.91	3.83
12	600150	中国船舶	24,682,632.95	3.82
13	601872	招商轮船	24,291,089.00	3.76
14	000725	京东方A	23,549,147.00	3.65
15	002475	立讯精密	22,997,113.00	3.56
16	688041	海光信息	22,895,969.48	3.55
17	601628	中国人寿	22,751,652.60	3.53
18	000426	兴业银锡	22,268,106.57	3.45
19	600549	厦门钨业	21,945,455.98	3.40

20	600036	招商银行	21,867,950.00	3.39
21	600276	恒瑞医药	21,749,550.71	3.37
22	300014	亿纬锂能	20,972,836.00	3.25
23	600026	中远海能	20,487,477.00	3.17
24	688256	寒武纪	19,604,408.24	3.04
25	600887	伊利股份	19,537,146.00	3.03
26	300308	中际旭创	19,229,765.35	2.98
27	603986	兆易创新	19,113,122.00	2.96
28	300476	胜宏科技	19,064,807.00	2.95
29	601088	中国神华	19,027,952.73	2.95
30	000651	格力电器	18,521,652.54	2.87
31	000063	中兴通讯	18,019,966.00	2.79
32	600487	亨通光电	17,936,833.00	2.78
33	600183	生益科技	17,914,266.00	2.78
34	600519	贵州茅台	17,818,280.00	2.76
35	603259	药明康德	17,762,782.00	2.75
36	601398	工商银行	17,739,191.00	2.75
37	002463	沪电股份	17,684,516.00	2.74
38	002916	深南电路	17,233,838.00	2.67
39	688002	睿创微纳	17,140,726.62	2.66
40	000988	华工科技	17,083,270.81	2.65
41	000792	盐湖股份	16,875,402.00	2.61
42	600309	万华化学	16,844,483.66	2.61
43	688012	中微公司	16,823,783.83	2.61
44	600031	三一重工	16,670,323.00	2.58
45	002851	麦格米特	16,602,458.45	2.57
46	002558	巨人网络	16,419,825.17	2.54
47	300059	东方财富	16,388,210.00	2.54
48	000333	美的集团	16,348,963.00	2.53
49	300136	信维通信	16,287,849.92	2.52
50	601138	工业富联	16,241,591.00	2.52

51	601988	中国银行	16,074,576.00	2.49
52	300124	汇川技术	15,965,444.30	2.47
53	301358	湖南裕能	15,784,365.00	2.45
54	002155	湖南黄金	15,251,077.20	2.36
55	002497	雅化集团	15,069,716.48	2.33
56	002517	恺英网络	15,001,489.00	2.32
57	601857	中国石油	14,826,717.00	2.30
58	002273	水晶光电	14,726,242.00	2.28
59	300442	润泽科技	14,676,147.00	2.27
60	603979	金诚信	14,299,597.58	2.22
61	300433	蓝思科技	14,212,992.00	2.20
62	603920	世运电路	14,133,273.00	2.19
63	300454	深信服	14,093,318.80	2.18
64	603659	璞泰来	13,975,342.00	2.17
65	002074	国轩高科	13,903,763.40	2.15
66	600111	北方稀土	13,656,632.84	2.12
67	600019	宝钢股份	13,434,363.00	2.08
68	300450	先导智能	13,355,702.00	2.07
69	600030	中信证券	13,317,700.00	2.06
70	688111	金山办公	13,111,941.72	2.03
71	600900	长江电力	13,039,504.00	2.02
72	601166	兴业银行	12,921,466.00	2.00

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	4,094,798,537.82
卖出股票收入（成交）总额	4,025,560,067.23

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	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

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019827	26国债01	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

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。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,799,905.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,799,905.33

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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 中证A 500指 数增 强A	8,7 23	36,137.53	202,505,326.37	64.2 4%	112,722,384.28	35.76%
博道 中证A 500指 数增 强C	11, 662	19,235.81	32,929,466.94	14.6 8%	191,398,545.05	85.32%
合计	20, 171	26,749.08	235,434,793.31	43.6 3%	304,120,929.33	56.37%

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	博道中证A500指 数增强A	69,876.01	0.02%
	博道中证A500指 数增强C	11,540.81	0.01%
	合计	81,416.82	0.02%

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	博道中证A500指数 增强A	0
	博道中证A500指数 增强C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	博道中证A500指数 增强A	0
	博道中证A500指数 增强C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道中证A500指数增强 A	博道中证A500指数增强 C
基金合同生效日(2025年01月23 日)基金份额总额	148,557,853.43	318,909,660.59
本报告期期初基金份额总额	210,082,633.67	278,609,212.11
本报告期基金总申购份额	188,997,577.06	194,092,316.79
减：本报告期基金总赎回份额	83,852,500.08	248,373,516.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本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。

§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

基金管理人的重大人事变动：无。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：2026年6月23日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。自本基金基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	1,829,009,680.06	22.56%	340,052.86	21.98%	-
中信证券（华南）	1	2,304,107,408.73	28.42%	451,858.46	29.21%	-
方正证券	2	1,517,623,333.26	18.72%	288,010.56	18.62%	-
山西证券	2	2,457,231,205.50	30.31%	466,869.89	30.18%	-

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	-	-	2,000.00	0.00%	-	-	-	-
中信证券（华南）	20,814,434.00	46.42%	40,876,000.00	39.59%	-	-	-	-
方正证券	3,603,121.00	8.04%	5,900,000.00	5.72%	-	-	-	-

山西证券	20,423,938.00	45.55%	56,458,000.00	54.69%	-	-	-	-
------	---------------	--------	---------------	--------	---	---	---	---

注：

- 1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；
- 2、基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：
 - （1）经营行为稳健规范，财务状况良好；
 - （2）具备良好的合规风控能力，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
 - （3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；
 - （4）具有较强的全方位金融服务及研究能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面。
- 3、基金交易单元的选择程序如下：
 - （1）本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用提供证券交易服务的证券公司；
 - （2）本基金管理人和被选中的证券经营机构签订相关协议。
- 4、报告期内，本基金已严格遵守证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2026-01-22
2	博道中证A500指数增强型证券投资基金2025年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-22
3	博道基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
4	博道基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2026-03-31

5	博道中证A500指数增强型证券投资基金2025年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
6	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2026-04-22
7	博道中证A500指数增强型证券投资基金2026年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-22
8	2025年度博道基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-30
9	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。

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