

博道衍晟混合型证券投资基金

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:兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年04月28日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	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	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	63
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	64
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	64
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	64
§8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68

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	68
§9 开放式基金份额变动	69
§10 重大事件揭示	69
10.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
10.4 基金投资策略的改变	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	70
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	70
10.8 其他重大事件	72
§11 备查文件目录	72
11.1 备查文件目录	72
11.2 存放地点	72
11.3 查阅方式	72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道衍晟混合型证券投资基金	
基金简称	博道衍晟混合	
基金主代码	026351	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026年04月28日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,404,262,485.26份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道衍晟混合A	博道衍晟混合C
下属分级基金的交易代码	026351	026352
报告期末下属分级基金的份额总额	262,115,812.63份	1,142,146,672.63份

2.2 基金产品说明

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

	票组合。本基金管理人会持续研究市场的状态以及市场变化，并对模型和模型所采用的因子做出适当更新或调整。本基金可投资于全市场的股票ETF以及本基金管理人管理的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金。本基金的基金投资策略采用定量分析和定性分析相结合的方式，根据本基金的投资目标和投资策略，优选符合策略配置需求的基金进行投资。本基金的国债期货投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率×85%+中证800红利低波动指数收益率×15%
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。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文璜	冯萌
	联系电话	021-80226288	021-52629999-213310
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-085-2888	95561
传真		021-80226289	021-62159217
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	上海市浦东新区银城路167号4楼
邮政编码		200122	200120
法定代表人		莫泰山	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
----------------	--------

登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.bdfund.cn
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年04月28日（基金合同生效日）-2026年06月30日)	
	博道衍晟混合A	博道衍晟混合C
本期已实现收益	-387,659.79	-2,472,658.80
本期利润	-2,669,749.31	-12,413,580.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0102	-0.0109
本期加权平均净值利润率	-1.02%	-1.09%
本期基金份额净值增长率	-1.02%	-1.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
	博道衍晟混合A	博道衍晟混合C
期末可供分配利润	-2,669,749.31	-12,413,580.74
期末可供分配基金份额利润	-0.0102	-0.0109
期末基金资产净值	259,446,063.32	1,129,733,091.89
期末基金份额净值	0.9898	0.9891
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
	博道衍晟混合A	博道衍晟混合C
基金份额累计净值增长率	-1.02%	-1.09%

注：

- 1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；
- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；
- 3、本基金合同生效日为2026年4月28日，基金合同生效日至本报告期期末，本基金运作时间未满半年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博道衍晟混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
自基金合同 生效起至今	-1.02%	0.21%	-1.37%	0.14%	0.35%	0.07%

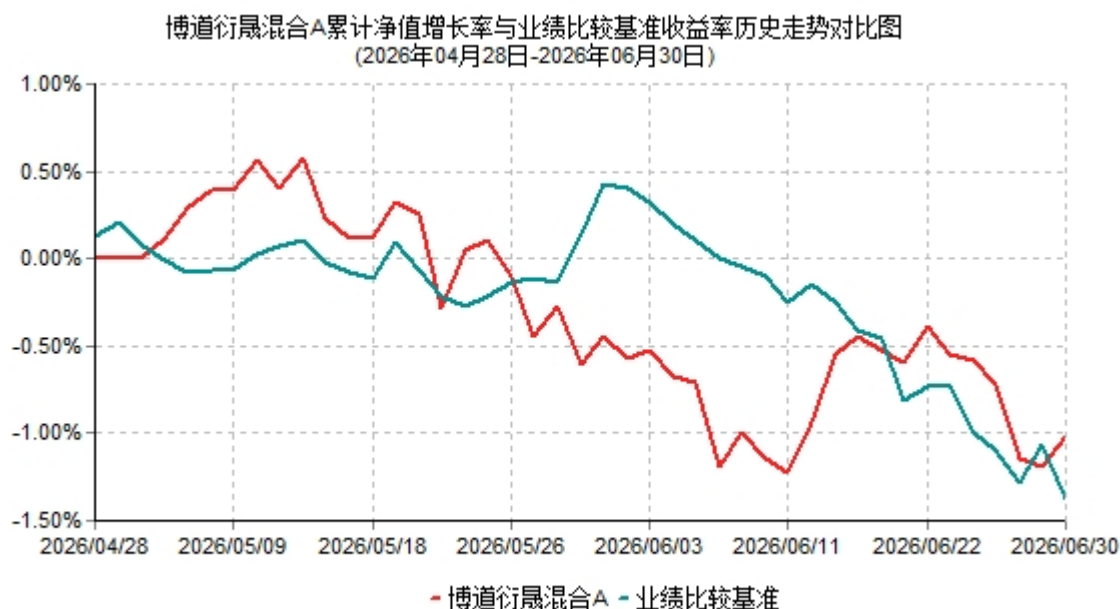
注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

博道衍晟混合C

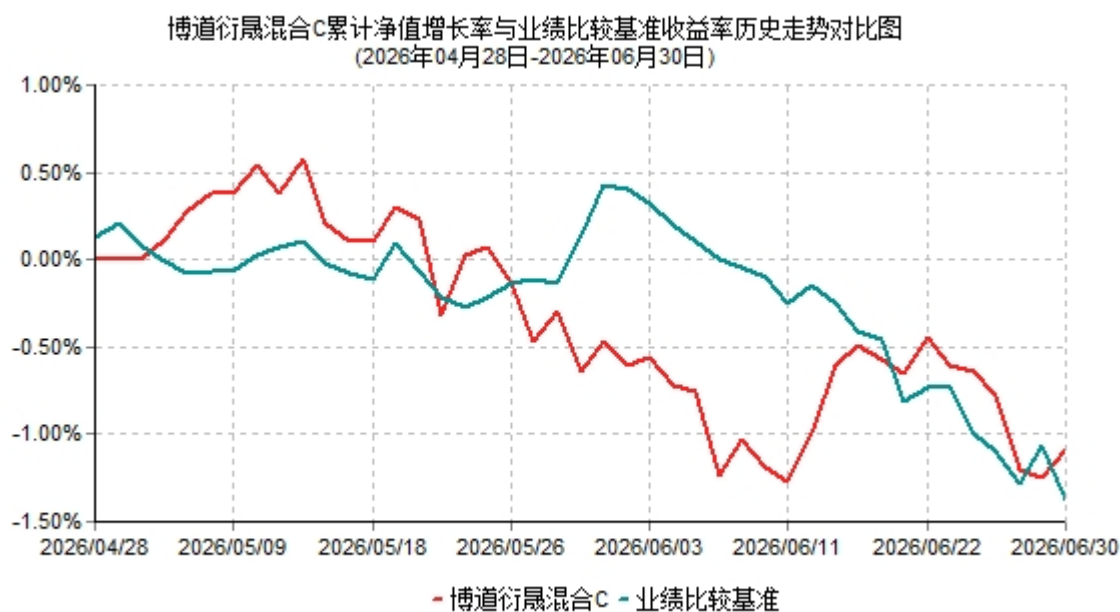
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
自基金合同 生效起至今	-1.09%	0.22%	-1.37%	0.14%	0.28%	0.08%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

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



注：本基金基金合同生效日为2026年4月28日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。基金合同生效日至报告期期末，本基金尚处于建仓期，且运作时间未满一年。



注：本基金基金合同生效日为2026年4月28日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。基金合同生效日至报告期期末，本基金尚处于建仓期，且运作时间未满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博道基金管理有限公司由中国证监会证监许可〔2017〕822号文核准设立，于2017年6月12日成立，注册地在中国上海，注册资本为1亿元人民币。公司具备公开募集证券投资基金管理、私募资产管理等业务资格。公司管理的首只公募基金于2018年8月10日成立。截至报告期末，公司旗下管理的公募基金涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金等多种类型。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
刘玮明	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合、博道久航混合、博道红利智航股票、博道大盘成长股票、博道大盘价值股票、博道衍和债券、博道衍晟混合、博道和裕多元稳健30天持有期债券、博道和祥多元稳健债券的基金经理	2026-04-28	-	7年	刘玮明先生，中国籍，金融硕士。2019年6月加入博道基金管理有限公司，历任量化投资部专户投资经理兼任高级量化研究员。具有基金从业资格。
马少杰	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合、博道衍和债券、博道衍晟混合、博道和裕多元稳健30天持有期债券、博道和祥多元稳健债券的基金经理助理	2026-04-28	-	6年	马少杰先生，中国籍，经济学硕士。2020年4月至2022年9月担任中国国际金融股份有限公司投资经理助理，2022年9月至2024年9月担任东方证券股份有限公司交易员，2024年9月至2026年3月担任鹏华基金管理有限公司基金经理助理。2026年3月加入博道基金管理有

					限公司。具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---------------

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026年上半年，受美以伊冲突、油价波动和流动性预期变化影响，全球市场剧烈震荡，风险偏好先抑后扬。国债收益率整体下行，2年期国债利率下行11BP到1.25%，10年期国债利率下行12BP到1.73%，中证综合债指数上涨2.02%。权益市场方面，A股主要宽基指数多数上涨，但结构分化明显，上证指数上涨3.16%，沪深300上涨7.55%，中证500上涨20.97%，中证1000上涨15.99%，而恒生指数下跌10.73%，恒生科技指数下跌

18.92%。风格上，中信成长风格指数上涨36.71%，中信周期风格指数下跌4.31%，中信消费风格指数下跌13.46%，中信金融风格指数下跌12.58%，中信稳定风格指数下跌6.36%。行业层面，电子、通信、建材涨幅居前，分别上涨85.49%、74.54%、43.70%，消费者服务、综合金融、综合跌幅较大，分别下跌31.88%、29.59%、25.09%。

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

报告期间，本基金主要配置于红利低波股票增强模型、以利率债为主的债券投资策略和量化可转债绝对收益策略，目标是借助低波股票投资思路改善组合权益仓位的风险收益特征，利用股债风险对冲来平衡产品的风险收益比，同时增加一部分可转债的差异化收益来源。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，主要宽基指数的预期盈利增速仍处于抬升阶段，预计市场重心将继续围绕基本面和产业趋势展开；对于量化类产品，需重点关注三四季度动量反转的可能性并做好防范应对。从资产配置和投资策略角度而言，在波动率提高的环境下，股债均衡的“固收+”产品的配置价值值得持续关注。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博道衍晟混合型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	682,188,279.17
结算备付金		76,545,797.92
存出保证金		116,577.59
交易性金融资产	6.4.7.2	630,841,418.89
其中：股票投资		205,191,000.83
基金投资		-
债券投资		425,650,418.06
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收清算款		1,848,036.66
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		1,391,540,110.23
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-

应付清算款		607,461.49
应付赎回款		-
应付管理人报酬		915,886.23
应付托管费		171,728.68
应付销售服务费		372,428.48
应付投资顾问费		-
应交税费		10,220.64
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.5	283,229.50
负债合计		2,360,955.02
净资产：		
实收基金	6.4.7.6	1,404,262,485.26
未分配利润	6.4.7.7	-15,083,330.05
净资产合计		1,389,179,155.21
负债和净资产总计		1,391,540,110.23

注：本报告期末基金份额净值请见"3.1 主要会计数据和财务指标"；基金份额请见"2.1 基金基本情况"。

6.2 利润表

会计主体：博道衍晟混合型证券投资基金

本报告期：2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年04月28日（基金合同 生效日）至2026年06月30 日
一、营业总收入		-11,957,779.79
1.利息收入		1,611,214.54
其中：存款利息收入	6.4.7.8	139,991.43
债券利息收入		-

资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,471,223.11
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,345,982.87
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-2,188,408.25
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.10	-804,982.15
资产支持证券投资收益	6.4.7.11	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益	6.4.7.13	1,647,407.53
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	-12,223,011.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-
减：二、营业总支出		3,125,550.26
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,932,150.71
2.托管费	6.4.10.2.2	362,278.31
3.销售服务费		785,700.60
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失		-
7.税金及附加		1,975.88
8.其他费用	6.4.7.16	43,444.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-15,083,330.05
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-15,083,330.05
五、其他综合收益的税后净额		-

六、综合收益总额		-15,083,330.05
----------	--	----------------

6.3 净资产变动表

会计主体：博道衍晟混合型证券投资基金

本报告期：2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	1,404,262,485.26	-	1,404,262,485.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-15,083,330.05	-15,083,330.05
（一）、综合收益总额	-	-15,083,330.05	-15,083,330.05
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,404,262,485.26	-15,083,330.05	1,389,179,155.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

莫泰山

张丽

严娅

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博道衍晟混合型证券投资基金（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[2025]2716号《关于准予博道衍晟混合型证券投资基金注册的批复》注册，由博道基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道衍晟混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,404,013,181.48元，业经容诚会计师事务所（特殊普通合伙）容诚验字[2026]200Z0090号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道衍晟混合型证券投资基金基金合同》于2026年4月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,404,262,485.26份基金份额，其中认购资金利息折合249,303.78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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《博道衍晟混合型证券投资基金基金合同》和《博道衍晟混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；投资人通过基金管理人认购/申购A类基金份额时不收取认购/申购费用。在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金财产中计提销售服务费并根据法律法规和基金合同的约定收取销售服务费的基金份额，称为C类基金份额；其中，对于投资者通过基金管理人认购/申购的C类基金份额所计提的销售服务费或者通过其他销售机构认购/申购且持续持有期限超过一年（即365天）的C类基金份额继续计提的销售服务费，将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者。相关费率的设置及费率水平在招募说明书或相关公告中列示。本基金两类基金份额分别设置代码，分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道衍晟混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款

（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股票（含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、股指期货、国债期货、股票期权、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（不包含QDII基金、香港互认基金、基金中基金和其他投资范围包含基金的基金、货币市场基金），以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、股票型基金、计入权益类资产的混合型基金等权益类资产及可交换债券和可转换债券（含分离交易可转债）的比例合计为基金资产的10%-30%，其中投资于境内股票资产（含境内上市且仅投资A股的ETF）的比例不低于基金资产的10%，投资于可交换债券和可转换债券（含分离交易可转债）的比例合计不超过基金资产的20%。上述计入权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：（1）基金合同约定股票（含存托凭证）资产投资比例应不低于基金资产的60%；（2）最近四个季度定期报告披露的股票（含存托凭证）资产投资比例均不低于基金资产的60%。本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的市值不超过基金资产净值的10%。本基金投资于同业存单比例不超过基金资产的20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为中债-综合全价（总值）指数收益率 $\times 85\%$ +中证800红利低波动指数收益率 $\times 15\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年06月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2026年06月30日的财务状况以及

2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年06月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具：

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具：

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<

关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	682,188,279.17
等于：本金	682,172,053.17
加：应计利息	16,226.00
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	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	682,188,279.17

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		216,615,816.03	-	205,191,000.83	-11,424,815.20
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	162,967,591.63	939,621.80	163,030,607.60	-876,605.83
	银行间市场	260,048,590.43	2,492,810.46	262,619,810.46	78,409.57
	合计	423,016,182.06	3,432,432.26	425,650,418.06	-798,196.26
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		639,631,998.09	3,432,432.26	630,841,418.89	-12,223,011.46

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证(如有)的成本、公允价值及公允价值变动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	241,419.74
其中：交易所市场	237,944.74
银行间市场	3,475.00
应付利息	-
预提费用-审计费	15,484.16
预提费用-信息披露费	23,225.60
预提费用-账户维护费	3,100.00
合计	283,229.50

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 博道衍晟混合A

金额单位：人民币元

项目 (博道衍晟混合A)	本期 2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	262,115,812.63	262,115,812.63
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	262,115,812.63	262,115,812.63

6.4.7.6.2 博道衍晟混合C

金额单位：人民币元

项目 (博道衍晟混合C)	本期 2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

基金合同生效日	1,142,146,672.63	1,142,146,672.63
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,142,146,672.63	1,142,146,672.63

注：

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；
- 3、本基金自2026年4月1日至2026年4月24日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币1,404,013,181.48元，折合为1,404,013,181.48份基金份额（其中A类基金份额262,070,991.30份，C类基金份额1,141,942,190.18份）。根据《博道衍晟混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币249,303.78元，折合为249,303.78份基金份额（其中A类基金份额44,821.33份，C类基金份额204,482.45份），划入基金份额持有人账户；
- 4、根据《博道衍晟混合型证券投资基金基金合同》、《博道衍晟混合型证券投资基金招募说明书》及《博道基金管理有限公司关于博道衍晟混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于2026年4月28日(基金合同生效日)至2026年7月27日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务、转换业务和定期定额投资业务自2026年7月28日起开始办理。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 博道衍晟混合A

单位：人民币元

项目 (博道衍晟混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-387,659.79	-2,282,089.52	-2,669,749.31
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-387,659.79	-2,282,089.52	-2,669,749.31

6.4.7.7.2 博道衍晟混合C

单位：人民币元

项目 (博道衍晟混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-2,472,658.80	-9,940,921.94	-12,413,580.74
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,472,658.80	-9,940,921.94	-12,413,580.74

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年06月30日
活期存款利息收入	120,876.25
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	19,078.01
其他	37.17
合计	139,991.43

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年06月30日

卖出股票成交总额	706,252,940.22
减：卖出股票成本总额	707,745,739.29
减：交易费用	695,609.18
买卖股票差价收入	-2,188,408.25

6.4.7.10 债券投资收益

6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年 06月30日
债券投资收益——利息收入	875,484.09
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,680,466.24
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	-804,982.15

6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	413,480,697.54
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	413,132,917.33
减：应计利息总额	2,006,567.32
减：交易费用	21,679.13
买卖债券差价收入	-1,680,466.24

6.4.7.11 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,647,407.53
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,647,407.53

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-12,223,011.46
——股票投资	-11,424,815.20
——债券投资	-798,196.26
——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	-12,223,011.46

6.4.7.15 其他收入

无。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年06月30日
审计费用	15,484.16
信息披露费	23,225.60
汇划手续费	1,635.00
账户维护费-中债登	1,500.00
账户维护费-上清所	1,600.00
合计	43,444.76

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
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年 06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,932,150.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	965,905.61
应支付基金管理人的净管理费	966,245.10

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04月28日（基金合同生效日）至2026年06月 30日
----	--

当期发生的基金应支付的托管费	362,278.31
----------------	------------

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道衍晟混合A	博道衍晟混合C	合计
兴业银行股份有限公司	-	785,616.10	785,616.10
合计	-	785,616.10	785,616.10

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计。具体收取/返还方式如下：

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

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

其计算公式为：日销售服务费=前一日C类基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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大于100万份。

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

关联方名称	本期 2026年04月28日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	682,188,279.17	120,876.25

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系，并明确了相应风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人兴业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2026年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为16.54%。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2026年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的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公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2026年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为1,314,254,047.23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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金及存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	682,188,279.17	-	-	-	-	-	682,188,279.17
结算备付金	76,545,797.92	-	-	-	-	-	76,545,797.92
存出保证金	116,577.59	-	-	-	-	-	116,577.59
交易性金融资产	49,971,796.03	-	193,358,052.17	86,634,534.66	95,686,035.20	205,191,000.83	630,841,418.89
应收清算款	-	-	-	-	-	1,848,036.66	1,848,036.66
资产总计	808,822,450.71	-	193,358,052.17	86,634,534.66	95,686,035.20	207,039,037.49	1,391,540,110.23
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	607,461.49	607,461.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	915,886.23	915,886.23

应付托管费	-	-	-	-	-	171,728.68	171,728.68
应付销售服务费	-	-	-	-	-	372,428.48	372,428.48
应交税费	-	-	-	-	-	10,220.64	10,220.64
其他负债	-	-	-	-	-	283,229.50	283,229.50
负债总计	-	-	-	-	-	2,360,955.02	2,360,955.02
利率敏感度缺口	808,822,450.71	-	193,358,052.17	86,634,534.66	95,686,035.20	204,678,082.47	1,389,179,155.21

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2026年06月30日
	1.市场利率下降25个基点	3,414,152.36
	2.市场利率上升25个基点	-3,302,289.54

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建

的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票、股票型基金、计入权益类资产的混合型基金等权益类资产及可交换债券和可转换债券（含分离交易可转债）的比例合计为基金资产的10%-30%，其中投资于境内股票资产（含境内上市且仅投资A股的ETF）的比例不低于基金资产的10%，投资于可交换债券和可转换债券（含分离交易可转债）的比例合计不超过基金资产的20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的保证金以后，现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	205,191,000.83	14.77
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	205,191,000.83	14.77

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2026年6月30日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例为14.77%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金净资产无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日
第一层次	274,701,876.35
第二层次	356,139,542.54
第三层次	-
合计	630,841,418.89

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	205,191,000.83	14.75
	其中：股票	205,191,000.83	14.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	425,650,418.06	30.59
	其中：债券	425,650,418.06	30.59
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	758,734,077.09	54.52
8	其他各项资产	1,964,614.25	0.14
9	合计	1,391,540,110.23	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,096,258.00	0.15
B	采矿业	9,003,693.00	0.65

C	制造业	141,635,919.38	10.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,392,374.50	0.46
E	建筑业	2,901,248.00	0.21
F	批发和零售业	15,760,819.00	1.13
G	交通运输、仓储和邮政业	3,647,284.00	0.26
H	住宿和餐饮业	1,173,094.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,832,637.00	0.42
J	金融业	7,105,379.95	0.51
K	房地产业	84,000.00	0.01
L	租赁和商务服务业	524,684.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	5,477,471.00	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	1,904,846.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	50,760.00	0.00
Q	卫生和社会工作	93,376.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,507,157.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	205,191,000.83	14.77

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	147,500	5,044,500.00	0.36
2	000554	泰山石油	787,200	4,416,192.00	0.32
3	300073	当升科技	90,400	4,342,816.00	0.31
4	600999	招商证券	146,700	3,095,370.00	0.22

5	600590	泰豪科技	275,600	2,783,560.00	0.20
6	600469	风神股份	468,100	2,546,464.00	0.18
7	603680	今创集团	258,900	2,539,809.00	0.18
8	000026	飞亚达	110,200	2,373,708.00	0.17
9	300516	久之洋	68,020	2,228,335.20	0.16
10	002643	万润股份	105,600	2,212,320.00	0.16
11	600230	沧州大化	164,400	2,140,488.00	0.15
12	600219	南山铝业	535,500	2,136,645.00	0.15
13	601600	中国铝业	253,500	2,083,770.00	0.15
14	002057	中钢天源	163,100	2,027,333.00	0.15
15	301039	中集车辆	268,200	1,890,810.00	0.14
16	603126	中材节能	289,700	1,825,110.00	0.13
17	002593	日上集团	452,100	1,803,879.00	0.13
18	601798	蓝科高新	239,200	1,731,808.00	0.12
19	000969	安泰科技	68,600	1,683,444.00	0.12
20	003035	南网能源	288,600	1,679,652.00	0.12
21	000657	中钨高新	16,600	1,588,952.00	0.11
22	300425	中建环能	421,100	1,574,914.00	0.11
23	603588	高能环境	80,400	1,543,680.00	0.11
24	600391	航发科技	45,300	1,515,285.00	0.11
25	300788	中信出版	65,900	1,480,773.00	0.11
26	600115	中国东航	372,900	1,420,749.00	0.10
27	300335	迪森股份	290,750	1,415,952.50	0.10
28	003020	立方制药	93,660	1,387,104.60	0.10
29	601606	长城军工	50,000	1,374,500.00	0.10
30	000901	航天科技	76,400	1,359,156.00	0.10
31	002228	合兴包装	461,100	1,355,634.00	0.10
32	002879	长缆科技	99,200	1,302,496.00	0.09
33	300132	青松股份	226,600	1,287,088.00	0.09
34	002328	新朋股份	175,200	1,285,968.00	0.09
35	002916	深南电路	2,800	1,282,120.00	0.09

36	002140	东华科技	137,800	1,263,626.00	0.09
37	603132	金徽股份	80,200	1,249,516.00	0.09
38	600738	丽尚国潮	345,300	1,243,080.00	0.09
39	300279	和晶科技	194,600	1,177,330.00	0.08
40	002523	天桥起重	380,600	1,134,188.00	0.08
41	603017	中衡设计	112,100	1,115,395.00	0.08
42	600710	苏美达	115,500	1,104,180.00	0.08
43	600969	郴电国际	143,300	1,093,379.00	0.08
44	002064	华峰化学	114,000	1,081,860.00	0.08
45	605299	舒华体育	81,000	1,081,350.00	0.08
46	000021	深科技	16,400	1,054,028.00	0.08
47	603101	汇嘉时代	168,700	1,052,688.00	0.08
48	300532	今天国际	168,480	1,049,630.40	0.08
49	688697	纽威数控	76,560	1,040,450.40	0.07
50	600299	安迪苏	131,800	1,034,630.00	0.07
51	600312	平高电气	58,400	1,031,344.00	0.07
52	688252	天德钰	42,400	1,017,600.00	0.07
53	002246	北化股份	54,100	1,017,080.00	0.07
54	301219	腾远钴业	18,520	1,014,896.00	0.07
55	002120	韵达股份	158,600	1,008,696.00	0.07
56	603998	方盛制药	107,500	970,725.00	0.07
57	000798	中水渔业	136,000	960,160.00	0.07
58	000975	山金国际	56,200	955,400.00	0.07
59	600547	山东黄金	41,300	953,617.00	0.07
60	600392	盛和资源	32,000	952,640.00	0.07
61	600030	中信证券	32,115	922,663.95	0.07
62	000762	西藏矿业	34,100	910,470.00	0.07
63	300932	三友联众	83,100	880,860.00	0.06
64	600100	同方股份	125,900	862,415.00	0.06
65	002757	南兴股份	47,700	860,985.00	0.06
66	000962	东方钽业	9,500	860,700.00	0.06

67	002090	金智科技	97,200	859,248.00	0.06
68	600550	保变电气	73,200	858,636.00	0.06
69	002281	光迅科技	3,300	847,902.00	0.06
70	300509	新美星	100,800	844,704.00	0.06
71	603095	越剑智能	57,000	816,240.00	0.06
72	002080	中材科技	8,900	801,000.00	0.06
73	300905	宝丽迪	15,300	774,180.00	0.06
74	600257	大湖股份	175,200	758,616.00	0.05
75	002478	常宝股份	121,800	752,724.00	0.05
76	300978	东箭科技	92,000	746,120.00	0.05
77	605056	咸亨国际	46,200	739,200.00	0.05
78	001299	美能能源	73,300	737,398.00	0.05
79	002236	大华股份	44,600	735,454.00	0.05
80	002826	易明医药	48,400	727,452.00	0.05
81	600435	北方导航	64,800	725,760.00	0.05
82	600583	海油工程	142,000	714,260.00	0.05
83	002540	亚太科技	150,700	703,769.00	0.05
84	301073	君亭酒店	37,800	687,960.00	0.05
85	601608	中信重工	140,200	668,754.00	0.05
86	603708	家家悦	77,800	667,524.00	0.05
87	600498	烽火通信	8,900	655,040.00	0.05
88	300215	电科院	97,700	643,843.00	0.05
89	603897	长城科技	19,800	642,708.00	0.05
90	002716	湖南白银	79,300	641,537.00	0.05
91	002532	天山铝业	57,900	621,267.00	0.04
92	002116	中国海诚	91,800	620,568.00	0.04
93	600489	中金黄金	34,000	613,700.00	0.04
94	002545	东方铁塔	37,700	611,494.00	0.04
95	002648	卫星化学	25,900	608,391.00	0.04
96	002632	道明光学	67,000	603,670.00	0.04
97	002380	科远智慧	17,400	594,732.00	0.04

98	600560	金自天正	53,300	590,564.00	0.04
99	300988	津荣天宇	37,640	588,313.20	0.04
100	600482	中国动力	17,800	583,840.00	0.04
101	002969	嘉美包装	40,700	573,056.00	0.04
102	300102	乾照光电	22,000	572,880.00	0.04
103	002134	天津普林	18,800	571,896.00	0.04
104	688648	中邮科技	15,400	562,870.00	0.04
105	301439	泓淋电力	35,800	562,776.00	0.04
106	300286	安科瑞	23,100	557,865.00	0.04
107	002398	垒知集团	148,401	556,503.75	0.04
108	688586	江航装备	47,600	556,444.00	0.04
109	300803	指南针	6,000	550,020.00	0.04
110	301360	荣旗科技	7,900	541,071.00	0.04
111	000933	神火股份	25,500	540,600.00	0.04
112	002947	恒铭达	7,000	532,350.00	0.04
113	002397	梦洁股份	137,700	526,014.00	0.04
114	002098	浔兴股份	82,100	525,440.00	0.04
115	300349	金卡智能	47,800	522,932.00	0.04
116	601968	宝钢包装	132,300	518,616.00	0.04
117	688080	映翰通	11,991	518,610.75	0.04
118	002998	优彩资源	79,500	517,545.00	0.04
119	000400	许继电气	23,800	516,460.00	0.04
120	002283	天润工业	53,500	516,275.00	0.04
121	688159	有方科技	11,600	514,924.00	0.04
122	603516	淳中科技	3,800	511,518.00	0.04
123	002823	凯中精密	35,500	505,520.00	0.04
124	300945	曼卡龙	45,800	496,014.00	0.04
125	601002	晋亿实业	113,400	489,888.00	0.04
126	300320	海达股份	51,000	486,540.00	0.04
127	601007	金陵饭店	79,400	485,134.00	0.03
128	002107	沃华医药	84,900	483,081.00	0.03

129	002284	亚太股份	50,500	479,245.00	0.03
130	600982	宁波能源	100,000	476,000.00	0.03
131	601218	吉鑫科技	109,800	472,140.00	0.03
132	300400	劲拓股份	12,500	470,625.00	0.03
133	000565	渝三峡 A	82,100	466,328.00	0.03
134	001316	润贝航科	14,000	461,720.00	0.03
135	002296	辉煌科技	51,800	459,984.00	0.03
136	600502	安徽建工	105,400	458,490.00	0.03
137	603799	华友钴业	9,500	458,470.00	0.03
138	600966	博汇纸业	95,100	454,578.00	0.03
139	600452	涪陵电力	47,700	445,041.00	0.03
140	603790	雅运股份	20,600	439,604.00	0.03
141	300993	玉马科技	45,100	438,372.00	0.03
142	300099	尤洛卡	69,200	437,344.00	0.03
143	002676	顺威股份	86,600	431,268.00	0.03
144	603217	元利科技	19,200	430,656.00	0.03
145	600176	中国巨石	5,900	429,992.00	0.03
146	600731	湖南海利	83,300	426,496.00	0.03
147	000923	河钢资源	34,300	425,663.00	0.03
148	002029	七匹狼	55,600	424,784.00	0.03
149	002922	伊戈尔	12,900	423,120.00	0.03
150	600425	青松建化	127,200	415,944.00	0.03
151	600361	创新新材	115,000	414,000.00	0.03
152	301329	信音电子	17,000	412,930.00	0.03
153	603082	北自科技	9,800	411,992.00	0.03
154	001283	豪鹏科技	8,400	411,768.00	0.03
155	002645	华宏科技	14,940	410,999.40	0.03
156	300843	胜蓝股份	2,600	406,250.00	0.03
157	603926	铁流股份	22,500	398,025.00	0.03
158	002178	延华智能	91,700	397,978.00	0.03
159	002636	金安国纪	3,300	395,901.00	0.03

160	600780	通宝能源	65,900	386,174.00	0.03
161	605196	华通线缆	14,700	383,670.00	0.03
162	000408	藏格矿业	5,500	381,260.00	0.03
163	002788	鹭燕医药	38,000	381,140.00	0.03
164	300308	中际旭创	300	381,000.00	0.03
165	600251	冠农股份	43,800	378,432.00	0.03
166	000001	平安银行	37,600	377,880.00	0.03
167	300970	华绿生物	20,650	377,482.00	0.03
168	601995	中金公司	10,400	375,960.00	0.03
169	002049	紫光国微	4,200	372,750.00	0.03
170	603933	睿能科技	16,400	369,820.00	0.03
171	000776	广发证券	15,800	369,720.00	0.03
172	300139	晓程科技	10,100	369,155.00	0.03
173	002419	天虹股份	85,800	362,934.00	0.03
174	301397	溯联股份	11,200	362,432.00	0.03
175	601168	西部矿业	13,300	360,962.00	0.03
176	300898	熊猫乳品	19,500	353,340.00	0.03
177	603489	八方股份	12,500	349,500.00	0.03
178	688981	中芯国际	2,200	349,404.00	0.03
179	300681	英搏尔	12,100	346,302.00	0.02
180	002429	兆驰股份	33,100	343,909.00	0.02
181	603948	建业股份	14,200	342,220.00	0.02
182	000949	新乡化纤	53,300	337,922.00	0.02
183	002363	隆基机械	55,500	334,110.00	0.02
184	603986	兆易创新	400	326,000.00	0.02
185	300986	志特新材	19,000	325,850.00	0.02
186	603279	景津装备	26,900	322,800.00	0.02
187	600830	香溢融通	40,400	321,988.00	0.02
188	300910	瑞丰新材	11,450	321,058.00	0.02
189	002404	嘉欣丝绸	55,300	316,316.00	0.02
190	605138	盛泰集团	57,200	315,744.00	0.02

191	300458	全志科技	8,000	315,680.00	0.02
192	601918	新集能源	36,300	311,817.00	0.02
193	688475	萤石网络	11,400	311,790.00	0.02
194	002911	佛燃能源	32,800	311,272.00	0.02
195	002170	芭田股份	28,600	310,596.00	0.02
196	001314	亿道信息	5,000	309,000.00	0.02
197	002117	东港股份	39,100	308,108.00	0.02
198	605179	一鸣食品	24,500	307,965.00	0.02
199	601865	福莱特	29,200	306,892.00	0.02
200	300515	三德科技	23,500	306,675.00	0.02
201	688766	普冉股份	400	306,640.00	0.02
202	300857	协创数据	900	305,910.00	0.02
203	002517	恺英网络	18,700	303,875.00	0.02
204	603088	宁波精达	30,200	303,812.00	0.02
205	002602	世纪华通	21,500	303,150.00	0.02
206	001332	锡装股份	7,700	302,379.00	0.02
207	603893	瑞芯微	1,600	301,376.00	0.02
208	603061	金海通	600	301,332.00	0.02
209	300407	凯发电气	27,700	299,160.00	0.02
210	601101	昊华能源	28,000	295,680.00	0.02
211	300864	南大环境	15,400	295,372.00	0.02
212	300360	炬华科技	24,700	290,225.00	0.02
213	300697	电工合金	18,900	286,335.00	0.02
214	002040	南京港	38,200	284,590.00	0.02
215	600259	中稀有色	2,800	284,508.00	0.02
216	001872	招商港口	14,600	283,678.00	0.02
217	300691	联合光电	17,200	271,932.00	0.02
218	600125	铁龙物流	53,500	271,245.00	0.02
219	301021	英诺激光	2,200	268,180.00	0.02
220	002042	华孚时尚	78,600	268,026.00	0.02
221	001337	四川黄金	7,300	267,618.00	0.02

222	600727	鲁北化工	39,500	265,440.00	0.02
223	600558	大西洋	52,700	260,338.00	0.02
224	300760	迈瑞医疗	1,900	258,077.00	0.02
225	688400	凌云光	3,800	251,560.00	0.02
226	002708	光洋股份	19,000	250,610.00	0.02
227	002271	东方雨虹	21,000	249,270.00	0.02
228	000426	兴业银锡	7,500	247,200.00	0.02
229	600785	新华百货	25,000	245,000.00	0.02
230	688309	恒誉环保	4,000	243,520.00	0.02
231	600506	统一股份	17,500	243,075.00	0.02
232	600858	银座股份	54,600	240,786.00	0.02
233	300475	香农芯创	800	240,000.00	0.02
234	603187	海容冷链	20,592	236,602.08	0.02
235	000100	TCL科技	40,500	235,710.00	0.02
236	000850	华茂股份	65,300	229,203.00	0.02
237	688486	龙迅股份	3,520	223,801.60	0.02
238	002833	弘亚数控	11,600	223,764.00	0.02
239	000715	中兴商业	47,700	221,328.00	0.02
240	600335	国机汽车	47,200	220,896.00	0.02
241	301377	鼎泰高科	400	220,360.00	0.02
242	603739	蔚蓝生物	19,100	220,223.00	0.02
243	301190	善水科技	13,700	219,611.00	0.02
244	300409	道氏技术	11,000	219,230.00	0.02
245	002259	升达林业	57,200	216,788.00	0.02
246	603380	易德龙	4,800	216,432.00	0.02
247	300050	世纪鼎利	36,200	214,304.00	0.02
248	000425	徐工机械	26,300	212,767.00	0.02
249	600406	国电南瑞	9,300	212,505.00	0.02
250	601988	中国银行	36,800	210,496.00	0.02
251	002763	汇洁股份	31,000	210,490.00	0.02
252	000570	苏常柴 A	44,700	208,749.00	0.02

253	000528	柳 工	27,500	207,625.00	0.01
254	301078	孩子王	30,500	206,180.00	0.01
255	001298	好上好	9,900	205,425.00	0.01
256	300590	移为通信	14,300	205,205.00	0.01
257	300373	扬杰科技	1,300	204,399.00	0.01
258	002389	航天彩虹	11,400	202,578.00	0.01
259	601328	交通银行	31,300	201,259.00	0.01
260	001358	兴欣新材	7,700	198,968.00	0.01
261	002824	和胜股份	5,700	197,106.00	0.01
262	301316	慧博云通	4,900	192,962.00	0.01
263	301079	邵阳液压	5,700	191,748.00	0.01
264	300980	祥源新材	6,500	191,165.00	0.01
265	603737	三棵树	7,900	190,390.00	0.01
266	600372	中航机载	17,300	187,705.00	0.01
267	300138	晨光生物	20,600	185,400.00	0.01
268	688128	中国电研	7,800	185,172.00	0.01
269	002683	广东宏大	6,300	184,527.00	0.01
270	002345	潮宏基	20,100	184,317.00	0.01
271	605289	罗曼股份	1,240	179,800.00	0.01
272	301129	瑞纳智能	8,600	179,482.00	0.01
273	600496	精工钢构	57,300	177,630.00	0.01
274	301057	汇隆新材	7,600	174,800.00	0.01
275	000738	航发控制	9,500	173,755.00	0.01
276	002454	松芝股份	36,340	173,705.20	0.01
277	601916	浙商银行	65,000	170,950.00	0.01
278	688558	国盛智科	5,200	170,872.00	0.01
279	600693	东百集团	21,600	169,344.00	0.01
280	300790	宇瞳光学	6,460	168,670.60	0.01
281	002479	富春环保	39,600	166,716.00	0.01
282	301279	金道科技	7,500	162,975.00	0.01
283	002811	郑中设计	14,100	157,779.00	0.01

284	300822	贝仕达克	13,300	155,610.00	0.01
285	300881	盛德鑫泰	4,100	153,545.00	0.01
286	605169	洪通燃气	17,100	152,019.00	0.01
287	603181	皇马科技	9,300	150,846.00	0.01
288	603299	苏盐井神	17,100	150,309.00	0.01
289	000589	贵州轮胎	36,900	149,814.00	0.01
290	300919	中伟新材	3,400	148,750.00	0.01
291	600171	上海贝岭	4,600	146,924.00	0.01
292	300927	江天化学	6,700	144,251.00	0.01
293	002156	通富微电	1,900	144,153.00	0.01
294	300063	天龙集团	16,500	143,220.00	0.01
295	000600	建投能源	16,300	142,625.00	0.01
296	600206	有研新材	2,100	139,860.00	0.01
297	301283	聚胶股份	5,690	139,291.20	0.01
298	601138	工业富联	1,900	137,085.00	0.01
299	002297	博云新材	4,700	136,253.00	0.01
300	300191	潜能恒信	4,900	135,485.00	0.01
301	688678	福立旺	5,600	135,352.00	0.01
302	300995	奇德新材	5,000	134,050.00	0.01
303	300017	网宿科技	10,200	132,702.00	0.01
304	601330	绿色动力	19,000	132,430.00	0.01
305	600875	东方电气	4,600	132,342.00	0.01
306	600339	中油工程	42,500	130,475.00	0.01
307	600903	贵州燃气	19,600	130,144.00	0.01
308	600546	山煤国际	11,900	130,067.00	0.01
309	688709	成都华微	3,400	129,506.00	0.01
310	601339	百隆东方	19,000	128,630.00	0.01
311	600970	中材国际	17,900	127,627.00	0.01
312	002734	利民股份	7,400	127,058.00	0.01
313	301077	星华新材	5,600	126,448.00	0.01
314	300473	德尔股份	4,100	124,640.00	0.01

315	300913	兆龙互连	2,600	124,566.00	0.01
316	600988	赤峰黄金	4,700	123,704.00	0.01
317	000301	东方盛虹	10,700	122,515.00	0.01
318	603283	赛腾股份	1,500	121,470.00	0.01
319	000786	北新建材	6,700	121,203.00	0.01
320	301175	中科环保	24,200	119,790.00	0.01
321	603296	华勤技术	1,600	118,832.00	0.01
322	001226	拓山重工	2,500	118,625.00	0.01
323	603486	科沃斯	2,300	116,725.00	0.01
324	601216	君正集团	26,000	115,960.00	0.01
325	300241	瑞丰光电	16,000	115,840.00	0.01
326	002166	莱茵生物	18,300	114,924.00	0.01
327	300661	圣邦股份	800	114,784.00	0.01
328	603885	吉祥航空	11,100	114,219.00	0.01
329	002020	京新药业	9,100	113,659.00	0.01
330	603929	亚翔集成	400	108,808.00	0.01
331	600027	华电国际	24,400	108,580.00	0.01
332	300953	震裕科技	800	106,960.00	0.01
333	301087	可孚医疗	2,200	104,830.00	0.01
334	000419	通程控股	22,900	103,279.00	0.01
335	002756	永兴材料	1,800	101,952.00	0.01
336	000407	胜利股份	26,900	99,530.00	0.01
337	000672	上峰材料	4,200	99,456.00	0.01
338	300452	山河药辅	8,500	99,280.00	0.01
339	002462	嘉事堂	9,100	97,643.00	0.01
340	002644	佛慈制药	14,300	97,383.00	0.01
341	300812	易天股份	3,300	96,723.00	0.01
342	002556	辉隆股份	21,500	96,320.00	0.01
343	002629	仁智股份	22,300	95,890.00	0.01
344	688208	道通科技	3,800	95,722.00	0.01
345	300415	伊之密	4,800	95,568.00	0.01

346	002401	中远海科	8,200	95,202.00	0.01
347	001376	百通能源	9,100	94,640.00	0.01
348	688230	芯导科技	1,200	94,572.00	0.01
349	301267	华夏眼科	6,400	93,376.00	0.01
350	603271	永杰新材	2,100	93,345.00	0.01
351	603993	洛阳钼业	5,300	93,015.00	0.01
352	002558	巨人网络	3,300	90,948.00	0.01
353	600356	恒丰纸业	12,200	90,402.00	0.01
354	601398	工商银行	12,600	89,082.00	0.01
355	603556	海兴电力	4,000	88,000.00	0.01
356	600050	中国联通	21,100	84,400.00	0.01
357	301295	美硕科技	2,000	84,360.00	0.01
358	002016	世荣兆业	21,000	84,000.00	0.01
359	002083	孚日股份	8,000	83,920.00	0.01
360	002935	天奥电子	3,800	83,372.00	0.01
361	301120	新特电气	5,000	83,150.00	0.01
362	002009	天奇股份	4,000	82,720.00	0.01
363	000800	一汽解放	13,500	80,325.00	0.01
364	600967	内蒙一机	7,400	80,290.00	0.01
365	300491	通合科技	2,100	80,199.00	0.01
366	002390	信邦制药	30,100	78,561.00	0.01
367	300622	博士眼镜	5,600	78,064.00	0.01
368	600926	杭州银行	5,400	78,030.00	0.01
369	000531	穗恒运 A	12,700	76,073.00	0.01
370	002565	顺灏股份	6,000	76,020.00	0.01
371	301137	哈焊华通	2,200	75,592.00	0.01
372	001378	德冠新材	4,200	75,222.00	0.01
373	601998	中信银行	10,800	74,844.00	0.01
374	000875	电投绿能	14,500	74,675.00	0.01
375	002158	汉钟精机	2,000	74,160.00	0.01
376	688536	思瑞浦	200	72,818.00	0.01

377	601939	建设银行	7,500	72,225.00	0.01
378	003031	中瓷电子	400	72,120.00	0.01
379	601388	怡球资源	25,400	71,882.00	0.01
380	603031	安孚科技	1,300	69,225.00	0.00
381	301026	浩通科技	3,400	68,748.00	0.00
382	300604	长川科技	200	68,284.00	0.00
383	002096	易普力	7,700	67,606.00	0.00
384	603967	中创物流	6,500	67,275.00	0.00
385	603112	华翔股份	4,000	66,920.00	0.00
386	000166	申万宏源	15,200	66,880.00	0.00
387	000997	新大陆	4,100	66,830.00	0.00
388	300388	节能国祯	10,700	66,019.00	0.00
389	000537	绿发电力	9,000	65,790.00	0.00
390	600011	华能国际	8,600	65,274.00	0.00
391	688045	必易微	800	64,624.00	0.00
392	600458	时代新材	3,800	62,890.00	0.00
393	603507	振江股份	1,900	62,491.00	0.00
394	002697	红旗连锁	15,000	62,400.00	0.00
395	605287	德才股份	1,500	62,235.00	0.00
396	002376	新北洋	10,800	62,100.00	0.00
397	002560	通达股份	8,300	61,752.00	0.00
398	600814	杭州解百	10,100	61,610.00	0.00
399	603871	嘉友国际	6,000	61,260.00	0.00
400	603165	荣晟环保	4,700	61,241.00	0.00
401	000703	恒逸石化	4,500	61,065.00	0.00
402	301048	金鹰重工	7,000	60,270.00	0.00
403	002179	中航光电	1,300	60,060.00	0.00
404	688779	五矿新能	7,400	60,014.00	0.00
405	300979	华利集团	2,000	59,500.00	0.00
406	301149	隆华新材	5,600	59,248.00	0.00
407	000950	重药控股	11,800	59,118.00	0.00

408	002046	国机精工	800	58,920.00	0.00
409	002942	新农股份	4,000	57,320.00	0.00
410	300908	仲景食品	2,600	57,304.00	0.00
411	601579	会稽山	3,900	57,291.00	0.00
412	601089	福元医药	3,500	56,980.00	0.00
413	600114	东睦股份	1,500	56,640.00	0.00
413	000733	振华科技	1,000	56,640.00	0.00
414	300797	钢研纳克	4,200	55,692.00	0.00
415	300206	理邦仪器	4,500	55,035.00	0.00
416	601677	明泰铝业	3,300	54,780.00	0.00
417	000655	金岭矿业	8,600	54,696.00	0.00
418	601869	长飞光纤	100	54,590.00	0.00
419	300701	森霸传感	5,600	53,592.00	0.00
420	688503	聚和材料	400	53,080.00	0.00
421	688183	生益电子	400	52,960.00	0.00
422	002320	海峡股份	8,400	52,668.00	0.00
423	600284	浦东建设	10,600	51,516.00	0.00
424	603966	法兰泰克	6,300	51,345.00	0.00
425	600549	厦门钨业	600	51,120.00	0.00
426	000968	蓝焰控股	8,500	50,915.00	0.00
427	000526	学大教育	2,000	50,760.00	0.00
428	603390	通达电气	4,800	50,112.00	0.00
429	300223	北京君正	200	49,780.00	0.00
430	001965	招商公路	5,400	49,464.00	0.00
431	002394	联发股份	5,500	49,060.00	0.00
432	002582	好想你	5,800	49,010.00	0.00
433	600130	波导股份	11,000	48,730.00	0.00
434	300058	蓝色光标	3,500	48,160.00	0.00
435	603518	锦泓集团	6,700	47,905.00	0.00
436	603989	艾华集团	900	47,250.00	0.00
437	601038	一拖股份	4,400	46,596.00	0.00

438	002498	汉缆股份	6,800	46,376.00	0.00
439	300389	艾比森	3,600	46,152.00	0.00
440	000683	博源化工	8,000	46,080.00	0.00
441	002155	湖南黄金	1,900	45,353.00	0.00
442	600916	中国黄金	6,600	45,144.00	0.00
443	688279	峰昭科技	200	44,888.00	0.00
444	300233	金城医药	3,600	44,640.00	0.00
445	301020	密封科技	2,000	43,680.00	0.00
446	605398	新炬网络	2,200	43,450.00	0.00
447	600362	江西铜业	1,000	43,300.00	0.00
448	002887	绿茵生态	4,100	42,927.00	0.00
449	002001	新 和 成	1,500	42,630.00	0.00
450	002256	兆新股份	11,400	41,382.00	0.00
451	601288	农业银行	6,800	41,276.00	0.00
452	600267	海正药业	4,000	40,440.00	0.00
453	000690	宝新能源	8,600	40,420.00	0.00
454	300840	酷特智能	1,900	39,197.00	0.00
455	688127	蓝特光学	400	39,040.00	0.00
456	300414	中光防雷	3,500	38,570.00	0.00
457	000700	模塑科技	2,600	38,376.00	0.00
458	603696	安记食品	3,300	37,950.00	0.00
459	600790	轻纺城	11,600	37,932.00	0.00
460	300130	新国都	1,800	37,872.00	0.00
461	603115	海星股份	300	36,741.00	0.00
462	301200	大族数控	100	36,065.00	0.00
463	000807	云铝股份	1,600	35,424.00	0.00
464	002054	德美化工	5,200	34,580.00	0.00
465	002877	智能自控	4,900	34,496.00	0.00
466	600787	中储股份	8,000	33,440.00	0.00
467	688722	同益中	2,200	33,374.00	0.00
468	301291	明阳电气	900	32,391.00	0.00

469	002849	威星智能	1,900	32,148.00	0.00
470	603266	天龙股份	1,900	31,977.00	0.00
471	300222	科大智能	2,300	31,855.00	0.00
472	600019	宝钢股份	5,800	31,494.00	0.00
473	605118	力鼎光电	900	31,401.00	0.00
474	002984	森麒麟	2,400	31,368.00	0.00
475	600739	辽宁成大	3,100	31,341.00	0.00
476	002960	青鸟智控	3,700	31,339.00	0.00
477	603558	健盛集团	2,800	31,052.00	0.00
478	688002	睿创微纳	200	30,938.00	0.00
479	300885	海昌新材	1,300	30,901.00	0.00
480	601377	兴业证券	5,000	30,200.00	0.00
481	600919	江苏银行	2,800	30,184.00	0.00
482	300043	星辉娱乐	6,900	30,015.00	0.00
483	688093	世华科技	800	29,520.00	0.00
484	601566	九牧王	3,600	29,268.00	0.00
485	300584	海辰药业	800	28,984.00	0.00
486	002081	金螳螂	6,600	28,578.00	0.00
487	002079	苏州固锟	1,900	28,557.00	0.00
488	603726	朗迪集团	800	27,400.00	0.00
489	002690	美亚光电	1,900	27,227.00	0.00
490	002722	物产金轮	2,300	27,117.00	0.00
491	605162	新中港	3,500	26,985.00	0.00
492	002412	汉森制药	4,900	26,950.00	0.00
493	002451	摩恩电气	3,800	26,752.00	0.00
494	301179	泽宇智能	1,300	26,598.00	0.00
495	301025	读客文化	3,400	26,384.00	0.00
496	600816	建元信托	10,800	26,352.00	0.00
497	300896	爱美客	300	26,160.00	0.00
498	002864	盘龙药业	1,000	25,800.00	0.00
499	600681	百川能源	7,900	25,517.00	0.00

500	688181	八亿时空	400	25,040.00	0.00
501	603383	顶点软件	900	23,904.00	0.00
501	601567	三星电气	1,600	23,904.00	0.00
502	002443	金洲管道	2,500	23,825.00	0.00
503	300486	东杰智能	1,100	23,485.00	0.00
504	002358	森源电气	4,200	23,310.00	0.00
505	002919	名臣健康	1,200	22,788.00	0.00
506	000333	美的集团	300	22,659.00	0.00
507	002270	华明装备	1,200	22,620.00	0.00
508	002241	歌尔股份	1,000	22,530.00	0.00
509	600601	方正科技	1,200	16,608.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600506	统一股份	11,114,913.00	0.80
2	002140	东华科技	9,895,120.00	0.71
3	002415	海康威视	9,454,896.00	0.68
4	603126	中材节能	7,599,245.00	0.55
5	000657	中钨高新	7,300,947.00	0.53
6	000554	泰山石油	7,278,381.00	0.52
7	300073	当升科技	7,025,099.00	0.51
8	002057	中钢天源	6,907,923.00	0.50
9	000026	飞亚达	6,670,209.00	0.48
10	000922	佳电股份	6,165,022.60	0.44
11	002643	万润股份	6,025,623.00	0.43
12	600469	风神股份	5,910,704.00	0.43
13	600391	航发科技	5,717,096.00	0.41

14	688475	萤石网络	5,676,672.18	0.41
15	600206	有研新材	5,522,760.00	0.40
16	600999	招商证券	5,510,876.00	0.40
17	601798	蓝科高新	5,428,005.00	0.39
18	688631	莱斯信息	5,276,838.62	0.38
19	300516	久之洋	5,222,090.00	0.38
20	600962	国投中鲁	5,129,206.00	0.37

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600506	统一股份	10,718,914.40	0.77
2	002140	东华科技	8,105,753.00	0.58
3	000657	中钨高新	6,748,672.00	0.49
4	000922	佳电股份	6,623,552.60	0.48
5	600206	有研新材	5,882,988.00	0.42
6	600962	国投中鲁	5,560,254.00	0.40
7	688456	有研粉材	5,462,916.48	0.39
8	603126	中材节能	5,239,384.00	0.38
9	688631	莱斯信息	5,227,819.59	0.38
10	002057	中钢天源	5,154,718.00	0.37
11	301137	哈焊华通	5,116,017.00	0.37
12	600552	凯盛科技	4,877,743.00	0.35
13	688475	萤石网络	4,808,797.54	0.35
14	000026	飞亚达	4,605,191.00	0.33
15	600505	西昌电力	4,524,587.00	0.33
16	600391	航发科技	4,443,049.00	0.32

17	600961	株冶集团	4,340,502.00	0.31
18	688981	中芯国际	4,246,395.25	0.31
19	688285	高铁电气	4,213,951.54	0.30
20	002643	万润股份	4,139,230.00	0.30

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	924,361,555.32
卖出股票收入（成交）总额	706,252,940.22

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	93,519,732.08	6.73
2	央行票据	-	-
3	金融债券	152,821,093.15	11.00
	其中：政策性金融债	102,367,810.96	7.37
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)	69,510,875.52	5.00
8	同业存单	99,749,881.24	7.18
9	其他	10,048,836.07	0.72
10	合计	425,650,418.06	30.64

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	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产
---	------	------	-------	------	-------

号					净值比例(%)
1	019827	26国债01	800,000	80,518,553.42	5.80
2	232680003	26中行二级资本债01BC	500,000	50,453,282.19	3.63
3	260401	26农发01	500,000	50,411,643.84	3.63
4	112508204	25中信银行CD204	500,000	49,971,796.03	3.60
5	112520282	25广发银行CD282	500,000	49,778,085.21	3.58

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10月31日，国家金融监督管理总局公示行政处罚决定书，给予中国银行股份有限公司罚款9790万元的行政处罚。
2025年8月1日，国家金融监督管理总局公示行政处罚决定书，给予中国农业发展银行罚款1020万元的行政处罚。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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	116,577.59
2	应收清算款	1,848,036.66
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,964,614.25

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127040	国泰转债	4,756,270.32	0.34
2	127082	亚科转债	4,130,116.64	0.30
3	123107	温氏转债	3,801,395.16	0.27
4	127049	希望转2	3,766,948.59	0.27
5	113054	绿动转债	3,750,909.84	0.27
6	127054	双箭转债	3,144,119.02	0.23
7	111002	特纸转债	2,969,132.61	0.21
8	110086	精工转债	2,813,028.56	0.20
9	127031	洋丰转债	2,811,176.09	0.20
10	127030	盛虹转债	2,710,379.90	0.20
11	110097	天润转债	2,625,299.75	0.19
12	113627	太平转债	2,513,250.86	0.18
13	127045	牧原转债	2,446,930.29	0.18
14	113042	上银转债	2,129,152.26	0.15
15	113655	欧22转债	2,023,754.21	0.15
16	123119	康泰转2	2,009,565.58	0.14
17	113062	常银转债	1,990,813.77	0.14
18	127102	浙建转债	1,866,016.42	0.13
19	111009	盛泰转债	1,791,291.23	0.13
20	113691	和邦转债	1,659,640.19	0.12
21	127067	恒逸转2	1,488,908.74	0.11
22	110087	天业转债	1,180,293.46	0.08

23	113616	韦尔转债	1,150,982.33	0.08
24	113058	友发转债	1,013,032.95	0.07
25	113661	福22转债	900,869.55	0.06
26	111017	蓝天转债	897,310.27	0.06
27	127084	柳工转2	891,036.39	0.06
28	110085	通22转债	886,652.25	0.06
29	113053	隆22转债	861,025.85	0.06
30	127108	太能转债	762,633.32	0.05
31	113670	金23转债	645,315.84	0.05
32	127110	广核转债	617,656.55	0.04
33	113631	皖天转债	503,136.08	0.04
34	127050	麒麟转债	398,271.16	0.03
35	127083	山路转债	287,488.70	0.02
36	118022	锂科转债	257,335.20	0.02
37	113647	禾丰转债	171,067.52	0.01
38	113633	科沃转债	141,396.39	0.01
39	127085	韵达转债	116,212.11	0.01
40	113046	金田转债	46,683.96	0.00
41	113056	重银转债	39,861.74	0.00
42	111014	李子转债	4,736.25	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额	持	户均持有的	持有人结构
----	---	-------	-------

级别	有 人 户 数 (户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
博道 衍晟 混合A	1,388	188,844.25	0.00	0.00%	262,115,812.63	100.00%
博道 衍晟 混合C	4,559	250,525.70	0.00	0.00%	1,142,146,672.63	100.00%
合计	5,912	237,527.48	0.00	0.00%	1,404,262,485.26	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博道衍晟混合A	2,141,193.58	0.82%
	博道衍晟混合C	200,024.44	0.02%
	合计	2,341,218.02	0.17%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博道衍晟混合A	>100
	博道衍晟混合C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	博道衍晟混合A	0
	博道衍晟混合C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道衍晟混合A	博道衍晟混合C
基金合同生效日(2026年04月28日)基金份额总额	262,115,812.63	1,142,146,672.63
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	262,115,812.63	1,142,146,672.63

注：

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	781,094,390.25	47.90%	113,979.69	47.90%	-
国泰海通证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	250,641,894.78	15.37%	36,578.36	15.37%	-

证券						
兴业 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	2	598,878,210.51	36.73%	87,386.69	36.73%	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-

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
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	195,052,702.48	25.35%	1,412,721,000.00	5.50%	-	-	-	-
国泰海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	89,275,672.84	11.60%	3,323,100,000.00	12.94%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	485,227,988.62	63.05%	20,945,839,000.00	81.56%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：

- 1、上述交易单元均为本基金新增交易单元；
- 2、基金管理人选择租用交易单元前，需综合考量其是否符合以下标准：
 - （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、能满足公募基金进行证券交易的需要；

(4) 具有较强的全方位金融服务及研究能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面。

3、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用提供证券交易服务的证券公司；
- (2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订相关协议。

4、报告期内，本基金已严格遵守证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博道基金管理有限公司关于博道衍晟混合型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-29
2	博道基金管理有限公司关于提醒客户及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-03

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道衍晟混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道衍晟混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道衍晟混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道衍晟混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道衍晟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、报告期内博道衍晟混合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