

博道星航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:招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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02月11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	7
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§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	63
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	63
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	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65

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	65
§9 开放式基金份额变动	65
§10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	66
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	67
10.8 其他重大事件	68
§11 备查文件目录	69
11.1 备查文件目录	69
11.2 存放地点	69
11.3 查阅方式	69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道星航混合型证券投资基金
基金简称	博道星航混合
基金主代码	026791
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2026年02月11日
基金管理人	博道基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,355,055,290.31份
基金合同存续期	不定期

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，本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报和更优的风险收益比。
投资策略	本基金主要配置于表征主动权益基金不同投资风格的SMART BETA选股策略，追求中长期超越同类平均水平的超额回报，力争实现更优的风险收益比。本基金充分发挥基金管理人的研究优势，结合宏观基本面、指数价量特征、风险偏好、资金流向等多维度因素的分析，在基金合同约定的比例范围内确定和调整大类资产配置比例，提高基金资产风险调整后收益。股票投资策略，首先，综合考虑股票的市值、盈利情况、风险情况等因素，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、成长、盈利能力、营运质量、事件性因素、价量特征等因素，对股票进行综合评价，通过量化选股模型优选个股构建股票投资组合并动态调整个股配置权重。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。

	此外，本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，采用定性和定量相结合的方法，优选基本面因素良好、估值水平合理的港股通标的股票纳入本基金的股票投资组合。本基金的债券投资采取主动的投资管理方式，以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，进行相应的久期配置和个券选择，构建债券投资组合，以期获得与风险相匹配的投资收益。本基金的可转换债券和可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+恒生指数收益率(按估值汇率折算)×5%+上证国债指数收益率×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。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛	张姗
	联系电话	021-80226288	400-61-95555
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-085-2888	400-61-95555
传真		021-80226289	0755-83195201
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200122	518040

法定代表人	莫泰山	缪建民
-------	-----	-----

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02月11日（基金合同生效日） - 2026年06月30日)
本期已实现收益	442,976,861.25
本期利润	562,844,236.99
加权平均基金份额本期利润	0.1681
本期加权平均净值利润率	16.14%
本期基金份额净值增长率	15.42%
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	542,704,236.07
期末可供分配基金份额利润	0.1246
期末基金资产净值	5,026,487,109.80

期末基金份额净值	1.1542
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	15.42%

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02月11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

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	22.10%	1.46%	10.55%	1.11%	11.55%	0.35%
自基金合同 生效起至今	15.42%	1.32%	4.28%	1.09%	11.14%	0.23%

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2月11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		
杨梦	博道中证500增强、博道沪深300增强、	2026-02-11	-	15年	杨梦女士，中国籍，经济学硕士。2011年7月至2014年6

	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				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，本基金维持配置于六大表征主动权益基金不同投资风格的SMART BETA选股策略。

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，通过配置于表征主动权益基金不同投资风格的SMART BETA选股策略，追求中长期超越同类平均水平的超额回报，力争实现更优的风险收益比。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：博道星航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	691,772,256.58
结算备付金		57,827,561.64
存出保证金		1,473,681.36
交易性金融资产	6.4.7.2	4,290,633,325.47
其中：股票投资		4,290,633,325.47
基金投资		-
债券投资		-
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		42,748,333.10
应收股利		-
应收申购款		1,567,784.39
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		5,086,022,942.54

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		18,091,548.90
应付赎回款		30,774,298.57
应付管理人报酬		5,100,911.08
应付托管费		850,151.84
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.5	4,718,922.35
负债合计		59,535,832.74
净 资 产：		
实收基金	6.4.7.6	4,355,055,290.31
未分配利润	6.4.7.7	671,431,819.49
净资产合计		5,026,487,109.80
负债和净资产总计		5,086,022,942.54

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：博道星航混合型证券投资基金

本报告期：2026年02月11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02月11日（基金合同生效日）至2026年06月30日
一、营业总收入		581,217,507.67
1.利息收入		1,408,453.97
其中：存款利息收入	6.4.7.8	1,408,453.97
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		453,234,461.62
其中：股票投资收益	6.4.7.9	434,094,707.25
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.10	-
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	19,139,754.37
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	119,867,375.74
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	6,707,216.34
减：二、营业总支出		18,373,270.68
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	15,672,336.79
2.托管费	6.4.10.2.2	2,612,056.14
3.销售服务费		-
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		-
8.其他费用	6.4.7.16	88,877.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		562,844,236.99
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		562,844,236.99
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		562,844,236.99

6.3 净资产变动表

会计主体：博道星航混合型证券投资基金

本报告期：2026年02月11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02月11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	2,732,598,180.82	-	2,732,598,180.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,622,457,109.49	671,431,819.49	2,293,888,928.98
（一）、综合收益总额	-	562,844,236.99	562,844,236.99
（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）	1,622,457,109.49	108,587,582.50	1,731,044,691.99
其中：1.基金申购款	2,816,543,612.44	227,090,509.09	3,043,634,121.53
2.基金赎回	-1,194,086,502.95	-118,502,926.59	-1,312,589,429.54

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	4,355,055,290.31	671,431,819.49	5,026,487,109.80

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

基金管理人负责人

张丽

主管会计工作负责人

严娅

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博道星航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]2803号《关于准予博道星航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《博道星航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2,732,287,876.30元，业经容诚会计师事务所（特殊普通合伙）容诚验字[2026]200Z0050号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道星航混合型证券投资基金基金合同》于2026年2月11日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,732,598,180.82份基金份额，其中认购资金利息折合310,304.52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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道星航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）、港股通标的股票、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、国债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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,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为60%-95%(其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的0%-50%)。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。如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人将在履行适当程序后,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800指数收益率 $\times 80\%$ +恒生指数收益率(按估值汇率折算) $\times 5\%$ +上证国债指数收益率 $\times 15\%$ 。

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02月11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02月11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02月11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和托管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

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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 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。

6.4.4.14 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利,H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中国结算")提出申请,由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册,H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利,由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	691,772,256.58
等于：本金	691,699,084.74
加：应计利息	73,171.84
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	691,772,256.58

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		4,170,765,949.73	-	4,290,633,325.47	119,867,375.74
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,170,765,949.73	-	4,290,633,325.47	119,867,375.74

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	4,633,823.55
其中：交易所市场	4,633,823.55
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	34,567.40
预提费用-信息披露费	47,531.40
预提费用-账户维护费	3,000.00
合计	4,718,922.35

6.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年02月11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	2,732,598,180.82	2,732,598,180.82
本期申购	2,816,543,612.44	2,816,543,612.44
本期赎回（以“-”号填列）	-1,194,086,502.95	-1,194,086,502.95
本期末	4,355,055,290.31	4,355,055,290.31

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02月03日至2026年02月09日止期间公开发售，共募集有效净认购资

金人民币2,732,287,876.30元，折合为2,732,287,876.30份基金份额。根据《博道星航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310,304.52元，折合为310,304.52份基金份额，划入基金份额持有人账户；

4、根据《博道星航混合型证券投资基金基金合同》、《博道星航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星航混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于2026年02月11日(基金合同生效日)至2026年04月09日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务和定期定额投资业务自2026年04月10日起开始办理。

6.4.7.7 未分配利润

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
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	442,976,861.25	119,867,375.74	562,844,236.99
本期基金份额交易产生的变动数	99,727,374.82	8,860,207.68	108,587,582.50
其中：基金申购款	169,566,682.04	57,523,827.05	227,090,509.09
基金赎回款	-69,839,307.22	-48,663,619.37	-118,502,926.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	542,704,236.07	128,727,583.42	671,431,819.49

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年02月11日（基金合同生效日）至2026年06月30日
活期存款利息收入	1,377,130.27
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	30,442.91
其他	880.79
合计	1,408,453.97

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02月11日（基金合同生效日）至2026年06月30日
卖出股票成交总额	17,361,029,860.47
减：卖出股票成本总额	16,910,181,701.10
减：交易费用	16,753,452.12
买卖股票差价收入	434,094,707.25

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

无。

6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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02月11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	19,139,754.37
基金投资产生的股利收益	-
合计	19,139,754.37

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02月11日（基金合同生效日）至2026年06月30日
1.交易性金融资产	119,867,375.74
——股票投资	119,867,375.74
——债券投资	-
——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	119,867,375.74

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年02月11日（基金合同生效日）至2026年06月30日
基金赎回费收入	6,707,216.34
合计	6,707,216.34

注：

1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费用全额归入基金资产；

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，其中转出基金的赎回费用全额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02月11日（基金合同生效日）至2026年06月30日
审计费用	34,567.40
信息披露费	47,531.40
汇划手续费	3,778.95
账户维护费-中债登	3,000.00
合计	88,877.75

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
招商银行股份有限公司	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02月11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	15,672,336.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,710,303.97
应支付基金管理人的净管理费	7,962,032.82

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%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02月11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	2,612,056.14

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.20%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。

6.4.10.3 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

份额单位：份

项目	本期 2026年02月11日（基金合同生效日）至2026年06月30日
基金合同生效日（2026年02月11日）持有的基金份额	8,001,466.66
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	8,001,466.66
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.18%

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、如果本报告期间发生认购、申购、转换入、红利再投、赎回、转换出等业务，本基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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02月11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
招商银行	691,772,256.58	1,377,130.27

股份有限 公司		
------------	--	--

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
001248	华润新能源	2026-06-24	6个月	主板打新限售	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
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	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	科创板打新限售	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
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	-

				售						
001248	华润新能源	2026-06-24	1个月内(含)	新股未上市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6个月	主板打新限售	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6个月	科创板打新限售	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	科创板打新限售	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	主板打新限售	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026-05-11	6个月	主板打新限售	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研新材	2026-04-01	6个月	科创板打新限售	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月	创业板打新限售	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6个月	主板打新限售	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特	2026-06-0	6个月	创业	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-

	电子	2		板打 新限售						
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	-
6034 07	长裕 集团	2026 -04-2 9	6个月	主板 打新 限售	13.86	73.46	137	1,89 8.82	10,06 4.02	-
3015 13	尚水 智能	2026 -04-1 0	6个月	创业 板打 新限售	26.66	50.96	138	3,67 9.08	7,03 2.48	-
6034 35	嘉德 利	2026 -05-1 5	6个月	主板 打新 限售	15.76	46.71	104	1,63 9.04	4,85 7.84	-
6032 93	埃泰 克	2026 -04-0 9	6个月	主板 打新 限售	33.49	33.93	72	2,41 1.28	2,44 2.96	-
0013 12	福恩 股份	2026 -04-1 4	6个月	主板 打新 限售	18.38	16.78	134	2,46 2.92	2,24 8.52	-

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

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招商银行，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，本基金无债券投资。

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上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约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综合持仓集中度指标、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0.05%。

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4,975,261,997.69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、存出保证金和债券投资等。

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	691,772,256.58	-	-	-	-	-	691,772,256.58
结算备付金	57,827,561.64	-	-	-	-	-	57,827,561.64
存出保证金	1,473,681.36	-	-	-	-	-	1,473,681.36
交易性金融资产	-	-	-	-	-	4,290,633,325.47	4,290,633,325.47
应收清算款	-	-	-	-	-	42,748,333.10	42,748,333.10

应收申购款	-	-	-	-	-	1,567,784.39	1,567,784.39
资产总计	751,073,499.58	-	-	-	-	4,334,949,442.96	5,086,022,942.54
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	18,091,548.90	18,091,548.90
应付赎回款	-	-	-	-	-	30,774,298.57	30,774,298.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,100,911.08	5,100,911.08
应付托管费	-	-	-	-	-	850,151.84	850,151.84
其他负债	-	-	-	-	-	4,718,922.35	4,718,922.35
负债总计	-	-	-	-	-	59,535,832.74	59,535,832.74
利率敏感度缺口	751,073,499.58	-	-	-	-	4,275,413,610.22	5,026,487,109.80

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，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

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。本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%（其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的0%-50%）。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	4,290,633,325.47	85.36
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	4,290,633,325.47	85.36

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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
	1.业绩比较基准收益率 上升5%	309,098,858.79
	2.业绩比较基准收益率 下降5%	-309,098,858.79

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	4,288,112,642.93
第二层次	850,291.44
第三层次	1,670,391.10
合计	4,290,633,325.47

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	4,290,633,325.47	84.36
	其中：股票	4,290,633,325.47	84.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	749,599,818.22	14.74
8	其他各项资产	45,789,798.85	0.90
9	合计	5,086,022,942.54	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	5,246,725.60	0.10
B	采矿业	192,408,051.49	3.83
C	制造业	3,527,607,745.02	70.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,698,414.44	0.49
E	建筑业	35,107,281.00	0.70
F	批发和零售业	118,462,596.75	2.36
G	交通运输、仓储和邮政业	10,498,994.20	0.21
H	住宿和餐饮业	2,942,940.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	83,083,907.49	1.65
J	金融业	203,362,775.46	4.05
K	房地产业	2,762,584.00	0.05
L	租赁和商务服务业	21,504,728.82	0.43
M	科学研究和技术服务业	20,090,318.00	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	42,856,263.20	0.85
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	4,290,633,325.47	85.36

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	300308	中际旭创	153,089	194,423,030.00	3.87
2	603986	兆易创新	105,941	86,341,915.00	1.72

3	002384	东山精密	324,104	85,028,684.40	1.69
4	300475	香农芯创	273,200	81,960,000.00	1.63
5	300857	协创数据	237,918	80,868,328.20	1.61
6	300073	当升科技	1,643,708	78,963,732.32	1.57
7	000657	中钨高新	729,480	69,825,825.60	1.39
8	688766	普冉股份	76,768	58,850,348.80	1.17
9	001309	德明利	59,308	55,921,513.20	1.11
10	300450	先导智能	1,275,099	51,922,031.28	1.03
11	688002	睿创微纳	333,632	51,609,534.08	1.03
12	301377	鼎泰高科	81,300	44,788,170.00	0.89
13	002716	湖南白银	5,182,900	41,929,661.00	0.83
14	688110	东芯股份	198,015	40,335,655.50	0.80
15	603588	高能环境	2,034,956	39,071,155.20	0.78
16	002415	海康威视	1,082,700	37,028,340.00	0.74
17	300953	震裕科技	269,120	35,981,344.00	0.72
18	300502	新易盛	57,220	34,732,540.00	0.69
19	002222	福晶科技	351,200	32,408,736.00	0.64
20	002281	光迅科技	120,900	31,064,046.00	0.62
21	688266	泽璟制药	263,400	30,728,244.00	0.61
22	601208	东材科技	433,406	30,680,810.74	0.61
23	601988	中国银行	5,147,000	29,440,840.00	0.59
24	000426	兴业银锡	879,700	28,994,912.00	0.58
25	300604	长川科技	82,394	28,130,959.48	0.56
26	300121	阳谷华泰	2,204,400	27,775,440.00	0.55
27	002532	天山铝业	2,453,680	26,327,986.40	0.52
28	603799	华友钴业	541,477	26,131,680.02	0.52
29	688525	佰维存储	51,800	25,627,014.00	0.51
30	688378	奥来德	402,959	24,983,458.00	0.50
31	002545	东方铁塔	1,486,100	24,104,542.00	0.48
32	601398	工商银行	3,370,300	23,828,021.00	0.47
33	688353	华盛锂电	201,400	23,376,498.00	0.47

34	002397	梦洁股份	6,051,400	23,116,348.00	0.46
35	600595	中孚实业	3,975,103	22,340,078.86	0.44
36	002648	卫星化学	948,000	22,268,520.00	0.44
37	002049	紫光国微	243,740	21,631,925.00	0.43
38	000703	恒逸石化	1,571,896	21,330,628.72	0.42
39	002643	万润股份	992,844	20,800,081.80	0.41
40	688531	日联科技	115,200	20,487,168.00	0.41
41	603993	洛阳钼业	1,150,800	20,196,540.00	0.40
42	000975	山金国际	1,187,600	20,189,200.00	0.40
43	600601	方正科技	1,425,200	19,724,768.00	0.39
44	002756	永兴材料	341,600	19,348,224.00	0.38
45	002998	优彩资源	2,949,400	19,200,594.00	0.38
46	002600	领益智造	1,106,700	19,190,178.00	0.38
47	300223	北京君正	76,100	18,941,290.00	0.38
48	603489	八方股份	668,214	18,683,263.44	0.37
49	301150	中一科技	295,228	18,631,839.08	0.37
50	603893	瑞芯微	98,896	18,628,050.56	0.37
51	002645	华宏科技	676,580	18,612,715.80	0.37
52	002402	和而泰	720,200	18,602,766.00	0.37
53	000933	神火股份	872,200	18,490,640.00	0.37
54	000776	广发证券	787,200	18,420,480.00	0.37
55	688358	祥生医疗	602,328	18,413,166.96	0.37
56	300458	全志科技	457,120	18,037,955.20	0.36
57	300681	英搏尔	627,553	17,960,566.86	0.36
58	002134	天津普林	585,500	17,810,910.00	0.35
59	000001	平安银行	1,722,168	17,307,788.40	0.34
60	002979	雷赛智能	309,849	17,283,377.22	0.34
61	601998	中信银行	2,450,650	16,983,004.50	0.34
62	000565	渝三峡 A	2,988,950	16,977,236.00	0.34
63	605138	盛泰集团	3,049,200	16,831,584.00	0.33
64	002636	金安国纪	138,300	16,591,851.00	0.33

65	601288	农业银行	2,676,400	16,245,748.00	0.32
66	002916	深南电路	34,730	15,902,867.00	0.32
67	301086	鸿富瀚	75,920	15,888,537.60	0.32
68	000949	新乡化纤	2,456,860	15,576,492.40	0.31
69	600498	烽火通信	210,200	15,470,720.00	0.31
70	603217	元利科技	674,200	15,122,306.00	0.30
71	301369	联动科技	60,702	14,871,990.00	0.30
72	603790	雅运股份	695,700	14,846,238.00	0.30
73	002938	鹏鼎控股	140,726	14,829,705.88	0.30
74	300750	宁德时代	37,700	14,816,477.00	0.29
75	300864	南大环境	769,399	14,757,072.82	0.29
76	002404	嘉欣丝绸	2,573,400	14,719,848.00	0.29
77	600499	科达制造	1,024,900	14,143,620.00	0.28
78	002851	麦格米特	83,700	13,992,966.00	0.28
79	301329	信音电子	575,200	13,971,608.00	0.28
80	688717	艾罗能源	167,900	13,863,503.00	0.28
81	300919	中伟新材	314,700	13,768,125.00	0.27
82	603083	剑桥科技	53,700	13,686,519.00	0.27
83	300735	光弘科技	593,000	13,484,820.00	0.27
84	300373	扬杰科技	84,900	13,348,827.00	0.27
85	002738	中矿资源	225,177	13,283,191.23	0.26
86	301222	浙江恒威	441,840	13,237,526.40	0.26
87	603933	睿能科技	581,800	13,119,590.00	0.26
88	603920	世运电路	269,500	12,946,780.00	0.26
89	603929	亚翔集成	47,400	12,893,748.00	0.26
90	300590	移为通信	895,200	12,846,120.00	0.26
91	688256	寒武纪	7,884	12,579,316.20	0.25
92	603739	蔚蓝生物	1,075,780	12,403,743.40	0.25
93	603061	金海通	24,645	12,377,211.90	0.25
94	300623	捷捷微电	268,400	12,075,316.00	0.24
95	000570	苏常柴 A	2,584,053	12,067,527.51	0.24

96	600460	士兰微	218,200	11,926,812.00	0.24
97	601166	兴业银行	718,900	11,904,984.00	0.24
98	600489	中金黄金	647,600	11,689,180.00	0.23
99	301308	江波龙	16,406	11,546,542.80	0.23
100	301021	英诺激光	93,900	11,446,410.00	0.23
101	002328	新朋股份	1,558,975	11,442,876.50	0.23
102	600999	招商证券	540,320	11,400,752.00	0.23
103	300666	江丰电子	30,800	11,352,880.00	0.23
104	600590	泰豪科技	1,110,900	11,220,090.00	0.22
105	001314	亿道信息	177,300	10,957,140.00	0.22
106	688309	恒誉环保	179,200	10,909,696.00	0.22
107	002236	大华股份	658,200	10,853,718.00	0.22
108	600549	厦门钨业	125,300	10,675,560.00	0.21
109	600176	中国巨石	144,600	10,538,448.00	0.21
110	688388	嘉元科技	237,920	10,468,480.00	0.21
111	002432	九安医疗	147,600	10,432,368.00	0.21
112	002943	宇晶股份	235,540	10,417,934.20	0.21
113	002763	汇洁股份	1,517,000	10,300,430.00	0.20
114	002064	华峰化学	1,078,398	10,233,997.02	0.20
115	600105	永鼎股份	149,400	10,081,512.00	0.20
116	301603	乔锋智能	69,800	10,037,240.00	0.20
117	603600	永艺股份	1,129,700	10,020,439.00	0.20
118	600727	鲁北化工	1,483,100	9,966,432.00	0.20
119	001339	智微智能	97,350	9,956,958.00	0.20
120	300416	苏试试验	488,300	9,951,554.00	0.20
121	600487	亨通光电	89,046	9,736,289.64	0.19
122	688159	有方科技	216,600	9,614,874.00	0.19
123	688400	凌云光	144,600	9,572,520.00	0.19
124	605299	舒华体育	710,700	9,487,845.00	0.19
125	600816	建元信托	3,887,425	9,485,317.00	0.19
126	600547	山东黄金	405,500	9,362,995.00	0.19

127	002155	湖南黄金	390,323	9,317,010.01	0.19
128	603132	金徽股份	586,000	9,129,880.00	0.18
129	601168	西部矿业	335,932	9,117,194.48	0.18
130	002195	岩山科技	1,393,800	9,115,452.00	0.18
131	000506	招金黄金	775,700	9,091,204.00	0.18
132	600219	南山铝业	2,274,800	9,076,452.00	0.18
133	600309	万华化学	132,500	9,064,325.00	0.18
134	001359	平安电工	72,200	9,043,050.00	0.18
135	300050	世纪鼎利	1,525,900	9,033,328.00	0.18
136	002922	伊戈尔	272,100	8,924,880.00	0.18
137	300473	德尔股份	293,100	8,910,240.00	0.18
138	688221	前沿生物	390,981	8,757,974.40	0.17
139	301360	荣旗科技	127,490	8,731,790.10	0.17
140	688981	中芯国际	54,600	8,671,572.00	0.17
141	002833	弘亚数控	448,980	8,660,824.20	0.17
142	001298	好上好	415,625	8,624,218.75	0.17
143	301190	善水科技	535,900	8,590,477.00	0.17
144	605289	罗曼股份	58,740	8,517,300.00	0.17
145	605117	德业股份	79,920	8,485,905.60	0.17
146	300115	长盈精密	301,400	8,421,116.00	0.17
147	300139	晓程科技	230,200	8,413,810.00	0.17
148	001358	兴欣新材	325,500	8,410,920.00	0.17
149	300661	圣邦股份	58,600	8,407,928.00	0.17
150	300400	劲拓股份	220,400	8,298,060.00	0.17
151	300760	迈瑞医疗	60,600	8,231,298.00	0.16
152	000923	河钢资源	658,100	8,167,021.00	0.16
153	300839	博汇股份	693,200	8,117,372.00	0.16
154	000408	藏格矿业	115,600	8,013,392.00	0.16
155	600742	富维股份	1,103,664	7,990,527.36	0.16
156	300691	联合光电	499,300	7,893,933.00	0.16
157	000969	安泰科技	320,600	7,867,524.00	0.16

158	601939	建设银行	815,200	7,850,376.00	0.16
159	301200	大族数控	21,664	7,813,121.60	0.16
160	300995	奇德新材	289,300	7,756,133.00	0.15
161	301079	邵阳液压	230,515	7,754,524.60	0.15
162	600903	贵州燃气	1,163,700	7,726,968.00	0.15
163	300432	富临精工	381,900	7,672,371.00	0.15
164	300803	指南针	83,500	7,654,445.00	0.15
165	301057	汇隆新材	331,400	7,622,200.00	0.15
166	605196	华通线缆	290,600	7,584,660.00	0.15
167	600919	江苏银行	692,400	7,464,072.00	0.15
168	300980	祥源新材	252,100	7,414,261.00	0.15
169	300164	通源石油	926,000	7,408,000.00	0.15
170	600251	冠农股份	857,400	7,407,936.00	0.15
171	002676	顺威股份	1,478,000	7,360,440.00	0.15
172	603626	科森科技	397,000	7,344,500.00	0.15
173	002475	立讯精密	103,200	7,265,280.00	0.14
174	002558	巨人网络	260,700	7,184,892.00	0.14
175	603160	汇顶科技	115,100	7,102,821.00	0.14
176	300697	电工合金	463,700	7,025,055.00	0.14
177	301219	腾远钴业	127,840	7,005,632.00	0.14
178	301276	嘉曼服饰	328,400	7,001,488.00	0.14
179	002436	兴森科技	137,200	6,990,340.00	0.14
180	300154	瑞凌股份	917,100	6,896,592.00	0.14
181	300988	津荣天宇	430,320	6,725,901.60	0.13
182	688678	福立旺	276,722	6,688,370.74	0.13
183	600230	沧州大化	512,900	6,677,958.00	0.13
184	002297	博云新材	227,500	6,595,225.00	0.13
185	000554	泰山石油	1,164,600	6,533,406.00	0.13
186	300191	潜能恒信	228,300	6,312,495.00	0.13
187	300905	宝丽迪	124,400	6,294,640.00	0.13
188	600546	山煤国际	575,600	6,291,308.00	0.13

189	601869	长飞光纤	11,500	6,277,850.00	0.12
190	001332	锡装股份	158,557	6,226,533.39	0.12
191	603507	振江股份	189,000	6,216,210.00	0.12
192	002271	东方雨虹	518,500	6,154,595.00	0.12
193	300014	亿纬锂能	94,200	6,125,826.00	0.12
194	002975	博杰股份	42,830	6,081,860.00	0.12
195	002120	韵达股份	947,900	6,028,644.00	0.12
196	300438	鹏辉能源	72,601	6,014,992.85	0.12
197	001226	拓山重工	126,500	6,002,425.00	0.12
198	603186	华正新材	26,500	5,970,450.00	0.12
199	603124	江南新材	31,700	5,927,266.00	0.12
200	300752	隆利科技	438,000	5,899,860.00	0.12
201	300584	海辰药业	162,100	5,872,883.00	0.12
202	002960	青鸟智控	691,920	5,860,562.40	0.12
203	002560	通达股份	786,320	5,850,220.80	0.12
204	603948	建业股份	238,400	5,745,440.00	0.11
205	300789	唐源电气	319,888	5,684,409.76	0.11
206	600502	安徽建工	1,297,720	5,645,082.00	0.11
207	002517	恺英网络	344,700	5,601,375.00	0.11
208	688148	芳源股份	649,362	5,571,525.96	0.11
209	600392	盛和资源	185,999	5,537,190.23	0.11
210	688668	鼎通科技	14,800	5,524,840.00	0.11
211	301295	美硕科技	130,700	5,512,926.00	0.11
212	300054	鼎龙股份	51,800	5,489,246.00	0.11
213	601328	交通银行	850,600	5,469,358.00	0.11
214	002284	亚太股份	573,400	5,441,566.00	0.11
215	002969	嘉美包装	384,500	5,413,760.00	0.11
216	688301	奕瑞科技	43,400	5,381,600.00	0.11
217	003020	立方制药	359,780	5,328,341.80	0.11
218	301631	壹连科技	74,026	5,319,508.36	0.11
219	301536	星宸科技	40,828	5,254,971.88	0.10

220	603897	长城科技	161,800	5,252,028.00	0.10
221	300970	华绿生物	287,020	5,246,725.60	0.10
222	002001	新 和 成	183,500	5,215,070.00	0.10
223	603516	淳中科技	38,500	5,182,485.00	0.10
224	603279	景津装备	430,600	5,167,200.00	0.10
225	300986	志特新材	299,400	5,134,710.00	0.10
226	601600	中国铝业	620,000	5,096,400.00	0.10
227	603266	天龙股份	299,800	5,045,634.00	0.10
228	002911	佛燃能源	531,300	5,042,037.00	0.10
229	605318	法狮龙	44,500	5,022,270.00	0.10
230	300233	金城医药	404,200	5,012,080.00	0.10
231	001203	大中矿业	166,900	4,998,655.00	0.10
232	300715	凯伦股份	291,000	4,789,860.00	0.10
233	000021	深科技	73,100	4,698,137.00	0.09
234	301122	采纳股份	158,600	4,664,426.00	0.09
235	600970	中材国际	636,900	4,541,097.00	0.09
236	688820	盛合晶微	23,902	4,503,047.30	0.09
237	300215	电科院	677,400	4,464,066.00	0.09
238	300758	七彩化学	355,200	4,457,760.00	0.09
239	300241	瑞丰光电	614,200	4,446,808.00	0.09
240	300703	创源股份	348,200	4,446,514.00	0.09
241	301662	宏工科技	43,665	4,424,137.80	0.09
242	603187	海容冷链	382,276	4,392,351.24	0.09
243	688230	芯导科技	55,623	4,383,648.63	0.09
244	600496	精工钢构	1,408,800	4,367,280.00	0.09
245	600232	金鹰股份	680,400	4,286,520.00	0.09
246	600926	杭州银行	295,900	4,275,755.00	0.09
247	300843	胜蓝股份	27,200	4,250,000.00	0.08
248	601138	工业富联	58,800	4,242,420.00	0.08
249	001313	粤海饲料	595,900	4,224,931.00	0.08
250	301020	密封科技	191,186	4,175,502.24	0.08

251	300908	仲景食品	187,915	4,141,646.60	0.08
252	300509	新美星	492,900	4,130,502.00	0.08
253	000683	博源化工	714,700	4,116,672.00	0.08
254	601918	新集能源	478,100	4,106,879.00	0.08
255	300606	金太阳	96,200	4,094,272.00	0.08
256	000528	柳工	540,700	4,082,285.00	0.08
257	001225	和泰机电	103,100	4,073,481.00	0.08
258	301081	严牌股份	297,000	4,062,960.00	0.08
259	688045	必易微	49,363	3,987,543.14	0.08
260	600583	海油工程	787,500	3,961,125.00	0.08
261	600875	东方电气	137,400	3,952,998.00	0.08
262	002534	西子洁能	213,000	3,951,150.00	0.08
263	688041	海光信息	10,600	3,925,180.00	0.08
264	001378	德冠新材	216,850	3,883,783.50	0.08
265	688558	国盛智科	117,800	3,870,908.00	0.08
266	300548	长芯博创	13,900	3,864,200.00	0.08
267	300102	乾照光电	147,000	3,827,880.00	0.08
268	300408	三环集团	22,700	3,788,630.00	0.08
269	002259	升达林业	999,500	3,788,105.00	0.08
270	603296	华勤技术	49,540	3,679,335.80	0.07
271	002708	光洋股份	274,700	3,623,293.00	0.07
272	600482	中国动力	110,300	3,617,840.00	0.07
273	688183	生益电子	27,200	3,601,280.00	0.07
274	002228	合兴包装	1,215,500	3,573,570.00	0.07
275	688516	奥特维	61,800	3,546,702.00	0.07
276	301056	森赫股份	314,500	3,522,400.00	0.07
277	300945	曼卡龙	325,200	3,521,916.00	0.07
278	605287	德才股份	84,600	3,510,054.00	0.07
279	300129	泰胜风能	408,200	3,490,110.00	0.07
280	688025	杰普特	7,400	3,478,000.00	0.07
281	300017	网宿科技	266,700	3,469,767.00	0.07

282	002451	摩恩电气	491,300	3,458,752.00	0.07
283	300628	亿联网络	101,950	3,447,949.00	0.07
284	605599	菜百股份	250,800	3,435,960.00	0.07
285	603228	景旺电子	47,400	3,432,234.00	0.07
286	688001	华兴源创	39,200	3,359,440.00	0.07
287	688536	思瑞浦	9,211	3,353,632.99	0.07
288	002379	宏桥控股	227,000	3,352,790.00	0.07
289	300058	蓝色光标	243,300	3,347,808.00	0.07
290	000425	徐工机械	409,000	3,308,810.00	0.07
291	688409	富创精密	10,800	3,307,500.00	0.07
292	301398	星源卓镁	94,200	3,307,362.00	0.07
293	600348	华阳股份	428,600	3,278,790.00	0.07
294	001389	广合科技	13,800	3,274,050.00	0.07
295	301279	金道科技	149,960	3,258,630.80	0.06
296	000960	锡业股份	75,110	3,206,445.90	0.06
297	300638	广和通	170,200	3,150,402.00	0.06
298	300461	田中精机	85,000	3,148,400.00	0.06
299	688639	华恒生物	195,000	3,147,300.00	0.06
300	000919	金陵药业	533,700	3,111,471.00	0.06
301	002170	芭田股份	285,400	3,099,444.00	0.06
302	002918	蒙娜丽莎	307,100	3,086,355.00	0.06
303	000100	TCL科技	529,900	3,084,018.00	0.06
304	603967	中创物流	295,500	3,058,425.00	0.06
305	000534	万泽股份	111,700	3,056,112.00	0.06
306	601899	紫金矿业	121,400	3,051,996.00	0.06
307	300322	硕贝德	120,300	3,031,560.00	0.06
308	301073	君亭酒店	161,700	2,942,940.00	0.06
309	300286	安科瑞	121,600	2,936,640.00	0.06
310	603383	顶点软件	110,500	2,934,880.00	0.06
311	002394	联发股份	329,000	2,934,680.00	0.06
312	300360	炬华科技	248,400	2,918,700.00	0.06

313	001360	南矿集团	164,900	2,917,081.00	0.06
314	603032	德新科技	108,200	2,910,580.00	0.06
315	002792	通宇通讯	81,800	2,909,626.00	0.06
316	300822	贝仕达克	247,685	2,897,914.50	0.06
317	601577	长沙银行	331,036	2,883,323.56	0.06
318	301439	泓淋电力	182,700	2,872,044.00	0.06
319	603025	大豪科技	209,900	2,863,036.00	0.06
320	002859	洁美科技	26,000	2,847,260.00	0.06
321	600203	福日电子	234,200	2,845,530.00	0.06
322	301136	招标股份	257,500	2,827,350.00	0.06
323	300952	恒辉安防	160,700	2,796,180.00	0.06
324	603101	汇嘉时代	445,500	2,779,920.00	0.06
325	603966	法兰泰克	340,480	2,774,912.00	0.06
326	300592	华凯易佰	154,800	2,739,960.00	0.05
327	688571	杭华股份	310,200	2,714,250.00	0.05
328	301316	慧博云通	68,600	2,701,468.00	0.05
329	300346	南大光电	29,091	2,695,281.15	0.05
330	603290	斯达半导	17,200	2,630,568.00	0.05
331	000932	华菱钢铁	751,406	2,607,378.82	0.05
332	003018	金富科技	34,200	2,607,066.00	0.05
333	000531	穗恒运 A	435,200	2,606,848.00	0.05
334	688252	天德钰	108,267	2,598,408.00	0.05
335	300939	秋田微	37,400	2,588,080.00	0.05
336	301358	湖南裕能	34,100	2,587,167.00	0.05
337	603019	中科曙光	24,000	2,573,520.00	0.05
338	300230	永利股份	608,300	2,554,860.00	0.05
339	301106	骏成科技	122,900	2,548,946.00	0.05
340	300567	精测电子	8,000	2,540,800.00	0.05
341	300774	倍杰特	236,300	2,540,225.00	0.05
342	002947	恒铭达	33,300	2,532,465.00	0.05
343	600801	华新建材	160,900	2,510,040.00	0.05

344	603320	迪贝电气	143,700	2,507,565.00	0.05
345	688010	福光股份	51,000	2,480,130.00	0.05
346	601069	西部黄金	112,300	2,470,600.00	0.05
347	688127	蓝特光学	25,000	2,440,000.00	0.05
348	301129	瑞纳智能	116,600	2,433,442.00	0.05
349	000810	创维数字	182,900	2,423,425.00	0.05
350	000987	越秀资本	309,200	2,417,944.00	0.05
351	002130	沃尔核材	126,400	2,396,544.00	0.05
352	301283	聚胶股份	97,200	2,379,456.00	0.05
353	300457	赢合科技	112,600	2,373,608.00	0.05
354	000419	通程控股	523,200	2,359,632.00	0.05
355	600362	江西铜业	54,200	2,346,860.00	0.05
356	002079	苏州固锔	155,100	2,331,153.00	0.05
357	000060	中金岭南	306,800	2,322,476.00	0.05
358	688028	沃尔德	14,800	2,306,876.00	0.05
359	600028	中国石化	516,000	2,301,360.00	0.05
360	000404	长虹华意	289,200	2,273,112.00	0.05
361	600299	安迪苏	289,100	2,269,435.00	0.05
362	000811	冰轮环境	40,300	2,265,666.00	0.05
363	601388	怡球资源	791,200	2,239,096.00	0.04
364	300881	盛德鑫泰	59,600	2,232,020.00	0.04
365	688697	纽威数控	163,800	2,226,042.00	0.04
366	300790	宇瞳光学	84,300	2,201,073.00	0.04
367	002156	通富微电	29,000	2,200,230.00	0.04
368	605056	咸亨国际	135,500	2,168,000.00	0.04
369	688279	峰昭科技	9,600	2,154,624.00	0.04
370	601658	邮储银行	436,000	2,149,480.00	0.04
371	600356	恒丰纸业	289,800	2,147,418.00	0.04
372	603798	康普顿	156,664	2,143,163.52	0.04
373	300310	宜通世纪	513,800	2,142,546.00	0.04
374	688503	聚和材料	15,950	2,116,565.00	0.04

375	002683	广东宏大	72,100	2,111,809.00	0.04
376	688006	杭可科技	57,400	2,097,970.00	0.04
377	300884	狄耐克	210,100	2,084,192.00	0.04
378	300260	新莱应材	20,600	2,069,476.00	0.04
379	300724	捷佳伟创	29,300	2,068,580.00	0.04
380	688475	萤石网络	75,200	2,056,720.00	0.04
381	002722	物产金轮	172,400	2,032,596.00	0.04
382	002612	朗姿股份	180,800	2,026,768.00	0.04
383	300856	科思股份	188,640	2,010,902.40	0.04
384	600361	创新新材	558,100	2,009,160.00	0.04
385	300063	天龙集团	230,900	2,004,212.00	0.04
386	002028	思源电气	11,500	1,989,500.00	0.04
387	688328	深科达	20,683	1,979,363.10	0.04
388	300339	润和软件	51,100	1,967,861.00	0.04
389	300335	迪森股份	397,100	1,933,877.00	0.04
390	600469	风神股份	350,400	1,906,176.00	0.04
391	688135	利扬芯片	44,836	1,886,698.88	0.04
392	600150	中国船舶	55,715	1,882,609.85	0.04
393	301195	北路智控	69,300	1,878,030.00	0.04
394	002877	智能自控	263,300	1,853,632.00	0.04
395	002057	中钢天源	149,000	1,852,070.00	0.04
396	603095	越剑智能	128,300	1,837,256.00	0.04
397	002315	焦点科技	78,730	1,832,834.40	0.04
398	003019	宸展光电	55,800	1,816,290.00	0.04
399	002582	好想你	213,200	1,801,540.00	0.04
400	600030	中信证券	62,600	1,798,498.00	0.04
401	000786	北新建材	98,900	1,789,101.00	0.04
402	688360	德马科技	97,000	1,736,300.00	0.03
403	688181	八亿时空	27,400	1,715,240.00	0.03
404	601677	明泰铝业	102,800	1,706,480.00	0.03
405	002283	天润工业	176,400	1,702,260.00	0.03

406	603093	南华期货	93,200	1,691,580.00	0.03
407	688628	优利德	16,800	1,662,192.00	0.03
408	688618	三旺通信	53,200	1,636,964.00	0.03
409	002966	苏州银行	235,000	1,635,600.00	0.03
410	603558	健盛集团	145,000	1,608,050.00	0.03
411	603067	振华股份	34,700	1,606,263.00	0.03
412	603283	赛腾股份	19,800	1,603,404.00	0.03
413	002824	和胜股份	46,300	1,601,054.00	0.03
414	688059	华锐精密	8,000	1,597,680.00	0.03
415	600738	丽尚国潮	440,800	1,586,880.00	0.03
416	002241	歌尔股份	70,400	1,586,112.00	0.03
417	603126	中材节能	250,200	1,576,260.00	0.03
418	000157	中联重科	226,000	1,575,220.00	0.03
419	601916	浙商银行	597,100	1,570,373.00	0.03
420	002154	报喜鸟	437,500	1,557,500.00	0.03
421	603680	今创集团	158,100	1,550,961.00	0.03
422	002396	星网锐捷	80,300	1,539,351.00	0.03
423	000407	胜利股份	413,000	1,528,100.00	0.03
424	300927	江天化学	69,600	1,498,488.00	0.03
425	600015	华夏银行	232,400	1,485,036.00	0.03
426	688018	乐鑫科技	11,600	1,483,872.00	0.03
427	002358	森源电气	267,100	1,482,405.00	0.03
428	301003	江苏博云	27,700	1,481,950.00	0.03
429	603038	华立股份	94,600	1,475,760.00	0.03
430	000026	飞亚达	68,100	1,466,874.00	0.03
431	002879	长缆科技	111,200	1,460,056.00	0.03
432	300279	和晶科技	241,300	1,459,865.00	0.03
433	600527	江南高纤	680,100	1,455,414.00	0.03
434	002244	滨江集团	189,400	1,439,440.00	0.03
435	001218	丽臣实业	65,180	1,437,870.80	0.03
436	002662	峰璟股份	388,400	1,437,080.00	0.03

437	300602	飞荣达	28,000	1,433,600.00	0.03
438	601872	招商轮船	80,360	1,411,925.20	0.03
439	600363	联创光电	39,100	1,398,998.00	0.03
440	600790	轻纺城	426,800	1,395,636.00	0.03
441	603390	通达电气	132,800	1,386,432.00	0.03
442	600941	中国移动	16,000	1,378,080.00	0.03
443	300679	电连技术	22,600	1,355,774.00	0.03
444	002203	海亮股份	59,200	1,352,720.00	0.03
445	688275	万润新能	10,400	1,326,520.00	0.03
446	002016	世荣兆业	330,786	1,323,144.00	0.03
447	601699	潞安环能	92,100	1,315,188.00	0.03
448	301016	雷尔伟	93,100	1,300,607.00	0.03
449	600865	百大集团	157,000	1,285,830.00	0.03
450	002009	天奇股份	62,100	1,284,228.00	0.03
451	003035	南网能源	218,400	1,271,088.00	0.03
452	002846	英联股份	119,700	1,267,623.00	0.03
453	601615	明阳智能	109,200	1,263,444.00	0.03
454	603685	晨丰科技	44,300	1,262,550.00	0.03
455	002887	绿茵生态	118,900	1,244,883.00	0.02
456	300491	通合科技	32,300	1,233,537.00	0.02
457	300410	正业科技	110,600	1,224,342.00	0.02
458	600098	广州发展	206,800	1,222,188.00	0.02
459	600966	博汇纸业	252,600	1,207,428.00	0.02
460	300658	延江股份	104,800	1,197,864.00	0.02
461	605007	五洲特纸	88,500	1,185,015.00	0.02
462	300837	浙矿股份	49,600	1,178,496.00	0.02
463	688385	复旦微电	16,400	1,169,156.00	0.02
464	002300	太阳电缆	172,700	1,167,452.00	0.02
465	301487	盟固利	60,500	1,158,575.00	0.02
466	603889	新澳股份	225,200	1,150,772.00	0.02
467	603650	彤程新材	11,700	1,146,366.00	0.02

468	002629	仁智股份	263,000	1,130,900.00	0.02
469	002463	沪电股份	7,300	1,115,440.00	0.02
470	300913	兆龙互连	22,891	1,096,707.81	0.02
471	300812	易天股份	37,400	1,096,194.00	0.02
472	688720	艾森股份	10,600	1,070,600.00	0.02
473	300870	欧陆通	3,000	1,037,070.00	0.02
474	688593	新相微	26,400	1,027,488.00	0.02
475	002054	德美化工	152,300	1,012,795.00	0.02
476	300007	汉威科技	25,500	974,100.00	0.02
477	002942	新农股份	65,500	938,615.00	0.02
478	603663	三祥新材	9,600	924,480.00	0.02
479	300804	广康生化	29,100	909,666.00	0.02
480	300920	润阳科技	25,700	887,935.00	0.02
481	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.02
482	002838	道恩股份	27,700	848,174.00	0.02
483	002655	共达电声	17,900	823,400.00	0.02
484	001326	联域股份	13,800	818,202.00	0.02
485	002470	金正大	399,400	806,788.00	0.02
486	000612	焦作万方	72,400	766,716.00	0.02
487	000878	云南铜业	45,100	716,188.00	0.01
488	002540	亚太科技	138,500	646,795.00	0.01
489	000807	云铝股份	26,800	593,352.00	0.01
490	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.01
491	301045	天禄科技	5,100	454,308.00	0.01
492	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
493	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
494	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
495	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
496	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
497	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
498	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00

499	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
500	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
501	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
502	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
503	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
504	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
505	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
506	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
507	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
508	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
509	001312	福恩股份	134	2,248.52	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	300308	中际旭创	309,216,313.35	6.15
2	000657	中钨高新	212,519,642.74	4.23
3	300857	协创数据	194,672,543.72	3.87
4	301308	江波龙	192,165,477.40	3.82
5	603986	兆易创新	166,592,462.40	3.31
6	688002	睿创微纳	166,591,650.58	3.31
7	002384	东山精密	162,990,723.44	3.24
8	300450	先导智能	155,911,764.98	3.10
9	300073	当升科技	144,934,722.76	2.88
10	002008	大族激光	136,254,031.00	2.71
11	688766	普冉股份	129,169,349.17	2.57
12	301358	湖南裕能	127,385,541.55	2.53
13	688525	佰维存储	125,520,388.21	2.50

14	601088	中国神华	124,158,677.71	2.47
15	002558	巨人网络	123,130,503.00	2.45
16	002716	湖南白银	122,962,397.00	2.45
17	600487	亨通光电	120,451,372.89	2.40
18	300438	鹏辉能源	114,425,506.53	2.28
19	300475	香农芯创	113,890,716.96	2.27
20	688256	寒武纪	112,447,022.10	2.24
21	001309	德明利	112,180,030.24	2.23
22	002222	福晶科技	111,681,939.78	2.22
23	688409	富创精密	111,370,848.62	2.22
24	600549	厦门钨业	110,023,643.08	2.19
25	002497	雅化集团	108,370,466.00	2.16
26	300604	长川科技	106,254,674.74	2.11
27	600601	方正科技	103,806,039.00	2.07
28	603588	高能环境	102,629,214.64	2.04

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	301308	江波龙	200,590,344.30	3.99
2	000657	中钨高新	181,312,962.36	3.61
3	300308	中际旭创	171,836,557.48	3.42
4	603986	兆易创新	161,848,396.75	3.22
5	300857	协创数据	158,771,507.03	3.16
6	002008	大族激光	142,358,534.24	2.83
7	688409	富创精密	135,271,855.02	2.69
8	688002	睿创微纳	129,427,130.04	2.57

9	601088	中国神华	128,358,759.96	2.55
10	301358	湖南裕能	126,029,027.50	2.51
11	600487	亨通光电	124,121,449.25	2.47
12	688766	普冉股份	123,158,424.56	2.45
13	688525	佰维存储	117,208,897.06	2.33
14	300438	鹏辉能源	116,139,388.72	2.31
15	688256	寒武纪	113,659,213.77	2.26
16	002384	东山精密	112,539,739.00	2.24
17	002558	巨人网络	111,797,051.00	2.22
18	002497	雅化集团	104,576,292.44	2.08
19	600549	厦门钨业	103,788,009.21	2.06
20	002463	沪电股份	99,375,477.27	1.98

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	21,080,947,650.83
卖出股票收入（成交）总额	17,361,029,860.47

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

无。

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

无。

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 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

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	1,473,681.36
2	应收清算款	42,748,333.10
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,567,784.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,789,798.85

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
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

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
22,422	194,231.35	77,125,643.38	1.77%	4,277,929,646.93	98.23%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,986,426.03	0.05%

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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2026年02月11日)基金份额总额	2,732,598,180.82
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,816,543,612.44
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,194,086,502.95
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	4,355,055,290.31

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。

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

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	
长江证券	2	9,595,644,050.05	24.96%	1,400,050.62	24.96%	-
广发证券	2	2,947,923,554.74	7.67%	430,128.30	7.67%	-
国泰海通证券	2	4,032,660,367.26	10.49%	588,379.87	10.49%	-
华泰证券	2	9,724,407,272.32	25.30%	1,418,844.55	25.30%	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	12,138,862,285.35	31.58%	1,771,115.11	31.58%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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》。

10.7.2 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

无。

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星航混合型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-12
2	博道基金管理有限公司关于博道星航混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告	上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-08
3	博道基金管理有限公司关于博道星航混合型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资）业务的公告	上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-08
4	博道基金管理有限公司关于博道星航混合型证券投资基金调整大额申购（含定期定额投资）业务的公告	上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-12
5	关于博道星航混合型证券投资基金调整大额申购（含定期定额投资）业务限额的公告	上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-15

	告		
6	博道基金管理有限公司关于博道星航混合型证券投资基金调整大额申购（含定期定额投资）业务限额的公告	上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-21
7	博道基金管理有限公司关于博道星航混合型证券投资基金申购申请进行比例配售的公告	上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-22
8	博道基金管理有限公司关于博道星航混合型证券投资基金申购比例确认结果的公告	上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-22
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星航混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道星航混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道星航混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道星航混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道星航混合型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内博道星航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