

博道大盘价值股票型证券投资基金

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:苏州银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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	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	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	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	58
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	59
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	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60

8.2 盈利投资者数量占比	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
8.4 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	61
§9 开放式基金份额变动	61
§10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	62
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	63
10.8 其他重大事件	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	65
§12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	66

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道大盘价值股票型证券投资基金	
基金简称	博道大盘价值股票	
基金主代码	021915	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024年12月03日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	苏州银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	93,537,831.42份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道大盘价值股票A	博道大盘价值股票C
下属分级基金的交易代码	021915	021916
报告期末下属分级基金的份额总额	35,959,567.71份	57,578,263.71份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注大盘价值风格相关上市公司股票的投资机会，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。
投资策略	本基金为股票型基金，以股票投资为主，通过量化选股模型构建股票组合，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。本基金所定义的大盘股票是指将所有上市交易的A股市场股票按照其在A股市场的自由流通市值从大到小进行排序，按照排序计算累计自由流通市值占比达到全市场70%的股票为大盘股票。基金因所持有股票价格的变化而导致大盘股票的投资比例低于基金合同规定的投资比例时，基金管理人可根据市场情况在合理期限内进行调整，至少每季度调整一次。在此期间对于未被纳入最近一次排序范围内的股票（如新股、非公开发行、恢复上市股票等），如果其自由流通市值可满足以上标准，也纳入大盘股票范

	围内。在按照上述标准筛选后的大盘股票范围内，综合考虑股票的估值、量价特征等因素，对股票进行综合评价，通过量化选股模型优选具备估值优势以及投资价值的大盘股票构建股票投资组合，其中投资于本基金界定的大盘股票的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金的股指期货投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、参与融资业务的策略和存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证800价值指数收益率×90%+同期银行活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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	苏州银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文璜	董平
	联系电话	021-80226288	0512-69868888-91017
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	custodyacc@suzhoubank.com
客户服务电话		400-085-2888	96067
传真		021-80226289	0512-65135118
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路728号
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路728号
邮政编码		200122	215100
法定代表人		莫泰山	崔庆军

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01月01日-2026年06月30日)	
	博道大盘价值股票 A	博道大盘价值股票 C
本期已实现收益	4,950,355.96	3,316,493.01
本期利润	2,789,411.80	-202,457.96
加权平均基金份额本期利润	0.0772	-0.0068
本期加权平均净值利润率	6.87%	-0.61%
本期基金份额净值增长率	7.38%	7.11%
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	4,773,757.73	7,122,490.55
期末可供分配基金份额利润	0.1328	0.1237
期末基金资产净值	40,733,325.44	64,700,754.26
期末基金份额净值	1.1328	1.1237
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	13.28%	12.37%

注：

- 1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；
- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博道大盘价值股票A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	7.38%	1.41%	-6.60%	0.80%	13.98%	0.61%
过去六个月	7.38%	1.33%	-9.22%	0.84%	16.60%	0.49%
过去一年	18.84%	1.06%	-3.38%	0.72%	22.22%	0.34%
自基金合同 生效起至今	13.28%	0.99%	-0.48%	0.75%	13.76%	0.24%

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。

博道大盘价值股票C

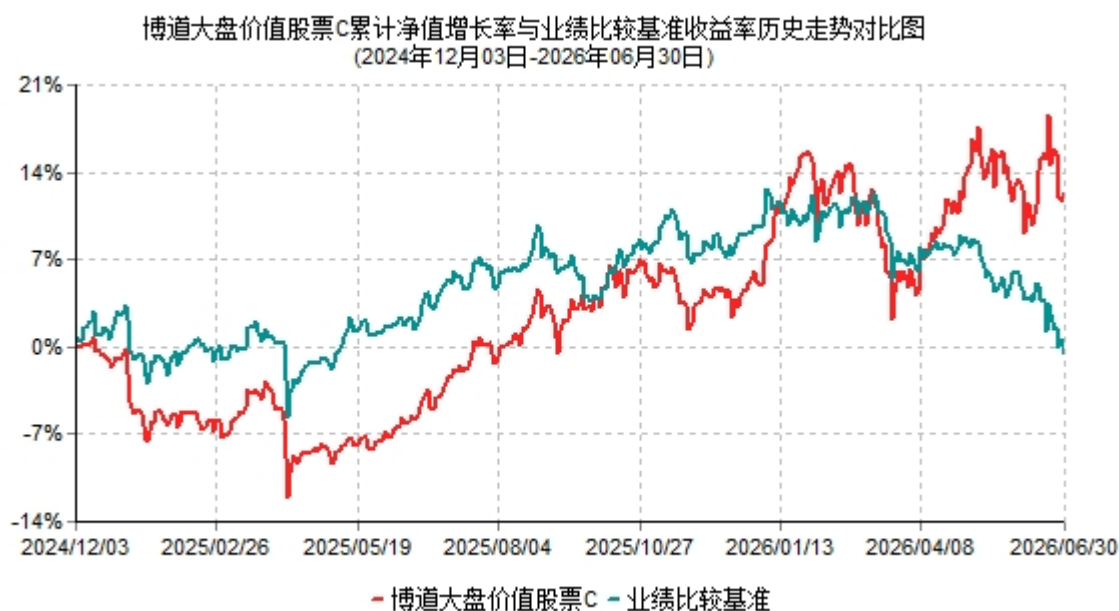
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	7.24%	1.41%	-6.60%	0.80%	13.84%	0.61%
过去六个月	7.11%	1.33%	-9.22%	0.84%	16.33%	0.49%
过去一年	18.22%	1.06%	-3.38%	0.72%	21.60%	0.34%
自基金合同 生效起至今	12.37%	0.99%	-0.48%	0.75%	12.85%	0.24%

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：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金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	2025-07-30	-	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。

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，本基金维持配置大盘价值SMART BETA选股模型。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人--博道基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博道基金管理有限公司编制和披露的本基金中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博道大盘价值股票型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,528,937.48	1,947,603.97
结算备付金		80,533.52	80,055.94
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	102,313,486.62	47,710,881.73
其中：股票投资		96,669,815.82	45,095,434.14
基金投资		-	-
债券投资		5,643,670.80	2,615,447.59
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,460.85	5,160.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		105,928,418.47	49,743,701.64
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		229,171.73	186,395.65
应付管理人报酬		105,922.75	51,519.09
应付托管费		17,653.78	8,586.50
应付销售服务费		27,369.48	5,461.51
应付投资顾问费		-	-
应交税费		191.17	95.85
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	114,029.86	68,008.01
负债合计		494,338.77	320,066.61
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	93,537,831.42	46,908,847.50
未分配利润	6.4.7.7	11,896,248.28	2,514,787.53
净资产合计		105,434,079.70	49,423,635.03

负债和净资产总计		105,928,418.47	49,743,701.64
----------	--	----------------	---------------

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：博道大盘价值股票型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		3,221,813.04	-6,252,921.17
1.利息收入		1,781.93	6,882.95
其中：存款利息收入	6.4.7.8	1,781.75	5,158.67
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		0.18	1,724.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		8,880,913.80	-13,386,675.65
其中：股票投资收益	6.4.7.9	7,714,615.99	-15,827,751.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	29,288.28	39,701.65
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	1,137,009.53	2,401,374.53
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失	6.4.7.14	-5,679,895.13	7,066,475.58

以“-”号填列)			
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	19,012.44	60,395.95
减：二、营业总支出		634,859.20	1,427,305.18
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	433,771.50	904,066.02
2.托管费	6.4.10.2.2	72,295.22	150,677.63
3.销售服务费		80,289.10	297,561.31
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		1,307.82	111.51
其中：卖出回购金融资产支出		1,307.82	111.51
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		84.88	-
8.其他费用	6.4.7.16	47,110.68	74,888.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		2,586,953.84	-7,680,226.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		2,586,953.84	-7,680,226.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,586,953.84	-7,680,226.35

6.3 净资产变动表

会计主体：博道大盘价值股票型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	46,908,847.50	2,514,787.53	49,423,635.03
二、本期期初净资产	46,908,847.50	2,514,787.53	49,423,635.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	46,628,983.92	9,381,460.75	56,010,444.67
（一）、综合收益总额	-	2,586,953.84	2,586,953.84
（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）	46,628,983.92	6,794,506.91	53,423,490.83
其中：1.基金申购款	64,509,838.41	9,108,590.23	73,618,428.64
2.基金赎回款	-17,880,854.49	-2,314,083.32	-20,194,937.81
（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	93,537,831.42	11,896,248.28	105,434,079.70
项 目	上年度可比期间		
	2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	241,368,063.43	-5,085,583.77	236,282,479.66
二、本期期初净资产	241,368,063.43	-5,085,583.77	236,282,479.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-111,844,430.86	-1,244,959.80	-113,089,390.66

填列)			
(一)、综合收益总额	-	-7,680,226.35	-7,680,226.35
(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)	-111,844,430.86	6,435,266.55	-105,409,164.31
其中: 1.基金申购款	8,887,641.15	-565,620.98	8,322,020.17
2.基金赎回款	-120,732,072.01	7,000,887.53	-113,731,184.48
(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	129,523,632.57	-6,330,543.57	123,193,089.00

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

博道大盘价值股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]892号《关于准予博道大盘价值股票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《博道大盘价值股票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241,293,208.77元，业经容诚会计师事务所（特殊普通合伙）容诚验字[2024]200Z0064号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道大盘价值股票型证券投资基金基金合同》于2024年12月3日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为241,368,063.43份基

金份额，其中认购资金利息折合74,854.66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，基金托管人为苏州银行股份有限公司。

根据《博道大盘价值股票型证券投资基金基金合同》和《博道大盘价值股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。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《博道大盘价值股票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）、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）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于80%，投资于本基金界定的大盘股票的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或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证800价值指数收益率 $\times 90\%$ +同期银行活期存款利率（税后） $\times 10\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令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	582,510.13
等于：本金	582,485.83
加：应计利息	24.30
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	2,946,427.35
等于：本金	2,946,390.11
加：应计利息	37.24
减：坏账准备	-
合计	3,528,937.48

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		102,111,213.23	-	96,669,815.82	-5,441,397.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	5,599,930.64	39,430.80	5,643,670.80	4,309.36
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,599,930.64	39,430.80	5,643,670.80	4,309.36
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		107,711,143.87	39,430.80	102,313,486.62	-5,437,088.05

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	3.18
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	7,439.10
预提费用-信息披露费	99,671.58
其他应付	6,916.00
合计	114,029.86

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 博道大盘价值股票A

金额单位：人民币元

项目 (博道大盘价值股票A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,106,210.70	36,106,210.70
本期申购	2,642,358.93	2,642,358.93
本期赎回（以“-”号填列）	-2,789,001.92	-2,789,001.92
本期末	35,959,567.71	35,959,567.71

6.4.7.6.2 博道大盘价值股票C

金额单位：人民币元

项目 (博道大盘价值股票C)	本期	
	2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,802,636.80	10,802,636.80
本期申购	61,867,479.48	61,867,479.48
本期赎回（以“-”号填列）	-15,091,852.57	-15,091,852.57
本期末	57,578,263.71	57,578,263.71

注：

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

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 博道大盘价值股票A

单位：人民币元

项目 (博道大盘价值股票A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,860,162.57	-876,196.82	1,983,965.75
本期期初	2,860,162.57	-876,196.82	1,983,965.75
本期利润	4,950,355.96	-2,160,944.16	2,789,411.80
本期基金份额交易产生的变动数	28,606.22	-28,226.04	380.18
其中：基金申购款	419,794.71	-71,256.88	348,537.83
基金赎回款	-391,188.49	43,030.84	-348,157.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,839,124.75	-3,065,367.02	4,773,757.73

6.4.7.7.2 博道大盘价值股票C

单位：人民币元

项目 (博道大盘价值股票C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	791,556.57	-260,734.79	530,821.78
本期期初	791,556.57	-260,734.79	530,821.78

本期利润	3,316,493.01	-3,518,950.97	-202,457.96
本期基金份额交易产生的变动数	7,887,953.52	-1,093,826.79	6,794,126.73
其中：基金申购款	10,173,571.41	-1,413,519.01	8,760,052.40
基金赎回款	-2,285,617.89	319,692.22	-1,965,925.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,996,003.10	-4,873,512.55	7,122,490.55

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	743.85
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	560.32
结算备付金利息收入	477.58
其他	-
合计	1,781.75

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	562,329,620.35
减：卖出股票成本总额	553,750,343.49
减：交易费用	864,660.87
买卖股票差价收入	7,714,615.99

6.4.7.10 债券投资收益

6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	23,585.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,703.06
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	29,288.28

6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	716,259.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	706,949.33
减：应计利息总额	3,602.36
减：交易费用	4.68
买卖债券差价收入	5,703.06

6.4.7.11 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,137,009.53

基金投资产生的股利收益	-
合计	1,137,009.53

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01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-5,679,895.13
——股票投资	-5,682,819.49
——债券投资	2,924.36
——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	-5,679,895.13

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	17,802.42
转换费收入	1,210.02
合计	19,012.44

注：

- 1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产；
- 2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基

金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。
具体以本基金最新的招募说明书为准。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	7,439.10
信息披露费	39,671.58
合计	47,110.68

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
苏州银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	433,771.50	904,066.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	69,487.39	330,891.50
应支付基金管理人的净管理费	364,284.11	573,174.52

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值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01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	72,295.22	150,677.63

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道大盘价值股票A	博道大盘价值股票C	合计
博道基金 管理有限 公司	-	10,720.81	10,720.81
苏州银行 股份有限 公司	-	-	-
合计	-	10,720.81	10,720.81
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间		
	2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道大盘价值股票A	博道大盘价值股票C	合计
博道基金 管理有限 公司	-	788.72	788.72
苏州银行 股份有限 公司	-	-	-
合计	-	788.72	788.72

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日基金销售服务费＝前一日C类基金份额对应的基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

博道大盘价值股票A

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	31,863,880.00	-
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	31,863,880.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	88.61%	-

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；
- 4、除上述情况外，报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金其他类别份额。

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10~50万份。（上年度末，除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。）

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01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

苏州银行股份有限公司	582,510.13	743.85	301,240.55	482.42
------------	------------	--------	------------	--------

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苏州银行，其他存款存放于国泰海通证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司和东吴证券股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于2026年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2025年12月31日：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0.01%)。

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105,699,168.77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	3,528,937.48	-	-	-	-	-	3,528,937.48
结算备付金	80,533.52	-	-	-	-	-	80,533.52
交易性金融资产	-	-	5,643,670.80	-	-	96,669,815.82	102,313,486.62
应收申购款	-	-	-	-	-	5,460.85	5,460.85
资产总计	3,609,471.00	-	5,643,670.80	-	-	96,675,276.67	105,928,418.47
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	229,171.73	229,171.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	105,922.75	105,922.75
应付托管费	-	-	-	-	-	17,653.78	17,653.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-	27,369.48	27,369.48
应交税费	-	-	-	-	-	191.17	191.17
其他负	-	-	-	-	-	114,029.86	114,029.86

债							
负债总计	-	-	-	-	-	494,338.77	494,338.77
利率敏感度缺口	3,609,471.00	-	5,643,670.80	-	-	96,180,937.90	105,434,079.70
上年度末 2025年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,947,603.97	-	-	-	-	-	1,947,603.97
结算备付金	80,055.94	-	-	-	-	-	80,055.94
交易性金融资产	-	-	2,608,447.51	-	7,000.08	45,095,434.14	47,710,881.73
应收申购款	-	-	-	-	-	5,160.00	5,160.00
资产总计	2,027,659.91	-	2,608,447.51	-	7,000.08	45,100,594.14	49,743,701.64
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	186,395.65	186,395.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	51,519.09	51,519.09
应付托管费	-	-	-	-	-	8,586.50	8,586.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,461.51	5,461.51
应交税费	-	-	-	-	-	95.85	95.85
其他负债	-	-	-	-	-	68,008.01	68,008.01
负债总计	-	-	-	-	-	320,066.61	320,066.61
利率敏感度缺	2,027,659.91	-	2,608,447.51	-	7,000.08	44,780,527.53	49,423,635.03

口							
---	--	--	--	--	--	--	--

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2026年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为5.35%(2025年12月31日：5.29%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2025年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金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。本基金投资组合中股票资产不低于基金资产的80%，投资于本基金界定的大盘股票的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
----	--------------------	---------------------

	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	96,669,815.82	91.69	45,095,434.14	91.24
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	96,669,815.82	91.69	45,095,434.14	91.24

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证800价值指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	1.中证800价值指数收益率上升5%	5,478,102.92	2,268,257.05
	2.中证800价值指数收益率下降5%	-5,478,102.92	-2,268,257.05

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	96,669,815.82	45,012,780.04
第二层次	5,643,670.80	2,615,447.59
第三层次	-	82,654.10
合计	102,313,486.62	47,710,881.73

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	96,669,815.82	91.26
	其中：股票	96,669,815.82	91.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,643,670.80	5.33
	其中：债券	5,643,670.80	5.33
	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	3,609,471.00	3.41
8	其他各项资产	5,460.85	0.01
9	合计	105,928,418.47	100.00

注：银行存款和结算备付金合计余额包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	62,480.00	0.06
B	采矿业	8,593,423.00	8.15
C	制造业	72,051,954.22	68.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,155,061.00	1.10
E	建筑业	2,087,044.00	1.98
F	批发和零售业	489,220.60	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	560,878.00	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,104,260.00	2.94
J	金融业	3,697,483.00	3.51
K	房地产业	93,480.00	0.09
L	租赁和商务服务业	21,336.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,753,196.00	4.51
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	96,669,815.82	91.69

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	603588	高能环境	241,100	4,629,120.00	4.39
2	002415	海康威视	133,600	4,569,120.00	4.33
3	300073	当升科技	81,800	3,929,672.00	3.73
4	688516	奥特维	63,978	3,671,697.42	3.48
5	002947	恒铭达	45,100	3,429,855.00	3.25
6	301219	腾远钴业	59,720	3,272,656.00	3.10
7	002396	星网锐捷	151,140	2,897,353.80	2.75
8	000969	安泰科技	100,700	2,471,178.00	2.34
9	603799	华友钴业	48,700	2,350,262.00	2.23
10	000975	山金国际	126,700	2,153,900.00	2.04

11	002938	鹏鼎控股	20,100	2,118,138.00	2.01
12	600547	山东黄金	88,700	2,048,083.00	1.94
13	002236	大华股份	114,600	1,889,754.00	1.79
14	002532	天山铝业	168,800	1,811,224.00	1.72
15	002756	永兴材料	28,300	1,602,912.00	1.52
16	600219	南山铝业	366,200	1,461,138.00	1.39
17	002080	中材科技	15,100	1,359,000.00	1.29
18	002545	东方铁塔	80,400	1,304,088.00	1.24
19	600498	烽火通信	17,400	1,280,640.00	1.21
20	000060	中金岭南	160,300	1,213,471.00	1.15
21	300409	道氏技术	59,100	1,177,863.00	1.12
22	002706	良信股份	102,900	1,122,639.00	1.06
23	000923	河钢资源	85,900	1,066,019.00	1.01
24	603948	建业股份	43,200	1,041,120.00	0.99
25	000933	神火股份	47,800	1,013,360.00	0.96
26	002833	弘亚数控	51,500	993,435.00	0.94
27	603993	洛阳钼业	56,400	989,820.00	0.94
28	300017	网宿科技	74,200	965,342.00	0.92
29	300919	中伟新材	21,200	927,500.00	0.88
30	600742	富维股份	126,200	913,688.00	0.87
31	002250	联化科技	66,500	909,055.00	0.86
32	600549	厦门钨业	10,500	894,600.00	0.85
33	600999	招商证券	40,500	854,550.00	0.81
34	601231	环旭电子	25,600	829,440.00	0.79
35	002911	佛燃能源	85,900	815,191.00	0.77
36	603929	亚翔集成	2,900	788,858.00	0.75
37	002517	恺英网络	47,400	770,250.00	0.73
38	600502	安徽建工	176,100	766,035.00	0.73
39	603187	海容冷链	62,500	718,125.00	0.68
40	600595	中孚实业	126,800	712,616.00	0.68
41	300230	永利股份	164,800	692,160.00	0.66

42	002379	宏桥控股	45,100	666,127.00	0.63
43	002170	芭田股份	59,900	650,514.00	0.62
44	002841	视源股份	18,700	645,711.00	0.61
45	000776	广发证券	25,900	606,060.00	0.57
46	601168	西部矿业	21,300	578,082.00	0.55
47	603279	景津装备	46,900	562,800.00	0.53
48	000703	恒逸石化	38,700	525,159.00	0.50
49	600970	中材国际	73,100	521,203.00	0.49
50	000811	冰轮环境	9,100	511,602.00	0.49
51	600496	精工钢构	161,800	501,580.00	0.48
52	002612	朗姿股份	44,300	496,603.00	0.47
53	000932	华菱钢铁	142,900	495,863.00	0.47
54	002558	巨人网络	17,900	493,324.00	0.47
55	603383	顶点软件	18,100	480,736.00	0.46
56	600926	杭州银行	31,500	455,175.00	0.43
57	601138	工业富联	6,300	454,545.00	0.43
58	002245	蔚蓝锂芯	23,900	447,169.00	0.42
59	605599	菜百股份	32,600	446,620.00	0.42
60	300724	捷佳伟创	6,300	444,780.00	0.42
61	603025	大豪科技	32,300	440,572.00	0.42
62	002203	海亮股份	19,200	438,720.00	0.42
63	000404	长虹华意	55,550	436,623.00	0.41
64	002271	东方雨虹	36,500	433,255.00	0.41
65	600176	中国巨石	5,900	429,992.00	0.41
66	600546	山煤国际	39,300	429,549.00	0.41
67	002648	卫星化学	18,200	427,518.00	0.41
68	000683	博源化工	74,100	426,816.00	0.40
69	002394	联发股份	47,400	422,808.00	0.40
70	600115	中国东航	110,000	419,100.00	0.40
71	000987	越秀资本	53,200	416,024.00	0.39
72	300628	亿联网络	11,700	395,694.00	0.38

73	300360	炬华科技	32,700	384,225.00	0.36
74	600499	科达制造	27,800	383,640.00	0.36
75	000157	中联重科	51,200	356,864.00	0.34
76	002683	广东宏大	12,000	351,480.00	0.33
77	000001	平安银行	34,600	347,730.00	0.33
78	002001	新 和 成	12,100	343,882.00	0.33
79	603966	法兰泰克	40,700	331,705.00	0.31
80	002273	水晶光电	9,100	322,868.00	0.31
81	601865	福莱特	29,400	308,994.00	0.29
82	688208	道通科技	11,400	287,166.00	0.27
83	002064	华峰化学	30,000	284,700.00	0.27
84	601567	三星电气	18,600	277,884.00	0.26
85	601577	长沙银行	31,700	276,107.00	0.26
86	600489	中金黄金	15,100	272,555.00	0.26
87	601600	中国铝业	32,800	269,616.00	0.26
88	600531	豫光金铅	18,000	265,680.00	0.25
89	600098	广州发展	43,700	258,267.00	0.24
90	000100	TCL科技	44,000	256,080.00	0.24
91	600583	海油工程	50,400	253,512.00	0.24
92	000425	徐工机械	30,200	244,318.00	0.23
93	002539	云图控股	21,500	243,380.00	0.23
94	002237	恒邦股份	16,000	235,040.00	0.22
95	002315	焦点科技	9,700	225,816.00	0.21
96	002432	九安医疗	3,100	219,108.00	0.21
97	002154	报 喜 鸟	59,000	210,040.00	0.20
98	600487	亨通光电	1,900	207,746.00	0.20
99	002241	歌尔股份	8,700	196,011.00	0.19
100	600362	江西铜业	4,200	181,860.00	0.17
101	600801	华新建材	11,000	171,600.00	0.16
102	603031	安孚科技	3,100	165,075.00	0.16
103	601918	新集能源	19,200	164,928.00	0.16

104	000528	柳 工	21,100	159,305.00	0.15
105	000878	云南铜业	10,000	158,800.00	0.15
106	600690	海尔智家	7,400	151,034.00	0.14
107	601677	明泰铝业	8,500	141,100.00	0.13
108	600875	东方电气	4,800	138,096.00	0.13
109	300760	迈瑞医疗	1,000	135,830.00	0.13
110	300413	芒果超媒	8,100	118,503.00	0.11
111	600030	中信证券	4,100	117,793.00	0.11
112	600114	东睦股份	3,100	117,056.00	0.11
113	601615	明阳智能	10,100	116,857.00	0.11
114	605117	德业股份	1,100	116,798.00	0.11
115	002155	湖南黄金	4,800	114,576.00	0.11
116	000951	中国重汽	5,700	111,207.00	0.11
117	000960	锡业股份	2,600	110,994.00	0.11
118	002206	海 利 得	20,800	107,536.00	0.10
119	002690	美亚光电	7,400	106,042.00	0.10
120	601566	九牧王	12,900	104,877.00	0.10
121	000733	振华科技	1,700	96,288.00	0.09
122	002468	申通快递	6,600	96,096.00	0.09
123	002244	滨江集团	12,300	93,480.00	0.09
124	002270	华明装备	4,900	92,365.00	0.09
125	000786	北新建材	5,100	92,259.00	0.09
126	601088	中国神华	2,200	85,888.00	0.08
127	600036	招商银行	2,300	81,650.00	0.08
128	301109	军信股份	6,100	76,006.00	0.07
129	601717	中创智领	5,300	73,723.00	0.07
130	000686	东北证券	8,300	69,720.00	0.07
131	600015	华夏银行	10,900	69,651.00	0.07
132	002961	瑞达期货	3,500	68,530.00	0.06
133	000612	焦作万方	6,400	67,776.00	0.06
134	603833	欧派家居	2,100	63,231.00	0.06

135	002772	众兴菌业	5,500	62,480.00	0.06
136	000543	皖能电力	8,100	61,317.00	0.06
137	603766	隆鑫通用	5,000	59,650.00	0.06
138	002372	伟星新材	7,100	58,149.00	0.06
139	601108	财通证券	5,700	49,305.00	0.05
140	600482	中国动力	1,500	49,200.00	0.05
141	000408	藏格矿业	700	48,524.00	0.05
142	600351	亚宝药业	8,400	48,300.00	0.05
143	002266	浙富控股	9,500	48,070.00	0.05
144	601377	兴业证券	7,900	47,716.00	0.05
145	600919	江苏银行	4,400	47,432.00	0.04
146	002185	华天科技	2,100	46,851.00	0.04
147	000630	铜陵有色	7,200	45,792.00	0.04
148	601872	招商轮船	2,600	45,682.00	0.04
149	601916	浙商银行	16,600	43,658.00	0.04
150	600694	大商股份	3,220	42,600.60	0.04
151	600028	中国石化	9,400	41,924.00	0.04
152	600211	西藏药业	1,100	41,129.00	0.04
153	002216	三全食品	3,000	34,590.00	0.03
154	601216	君正集团	7,500	33,450.00	0.03
155	601288	农业银行	5,000	30,350.00	0.03
156	601998	中信银行	4,300	29,799.00	0.03
157	601988	中国银行	5,000	28,600.00	0.03
158	603995	甬金股份	1,200	27,852.00	0.03
159	603659	璞泰来	900	26,037.00	0.02
160	600941	中国移动	300	25,839.00	0.02
161	603486	科沃斯	500	25,375.00	0.02
162	601126	四方股份	400	25,280.00	0.02
163	000997	新大陆	1,500	24,450.00	0.02
164	002202	金风科技	1,000	23,900.00	0.02
165	002493	荣盛石化	2,200	23,650.00	0.02

166	000559	万向钱潮	1,800	23,274.00	0.02
167	601997	贵阳银行	4,500	23,085.00	0.02
168	000623	吉林敖东	1,300	23,049.00	0.02
169	000333	美的集团	300	22,659.00	0.02
170	600031	三一重工	1,300	22,464.00	0.02
171	603619	中曼石油	1,200	22,452.00	0.02
172	601166	兴业银行	1,300	21,528.00	0.02
173	600415	小商品城	2,100	21,336.00	0.02
174	002429	兆驰股份	2,000	20,780.00	0.02
175	600348	华阳股份	2,700	20,655.00	0.02
176	000899	赣能股份	2,100	20,286.00	0.02
177	600563	法拉电子	100	19,080.00	0.02
178	600183	生益科技	100	17,340.00	0.02
179	600741	华域汽车	1,100	17,072.00	0.02
180	000596	古井贡酒	200	15,960.00	0.02
181	601229	上海银行	1,500	13,020.00	0.01
182	002895	川恒股份	400	11,680.00	0.01
183	600039	四川路桥	1,400	10,948.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603588	高能环境	14,729,582.00	29.80
2	002706	良信股份	10,897,596.00	22.05
3	002558	巨人网络	10,638,215.00	21.52
4	601138	工业富联	9,966,181.00	20.16
5	601609	金田股份	9,832,738.00	19.89
6	600114	东睦股份	9,335,806.00	18.89

7	002008	大族激光	9,100,864.00	18.41
8	688772	珠海冠宇	9,089,565.43	18.39
9	301219	腾远钴业	8,681,662.00	17.57
10	002415	海康威视	8,267,072.00	16.73
11	600549	厦门钨业	7,877,901.08	15.94
12	002396	星网锐捷	7,875,180.80	15.93
13	300073	当升科技	7,420,723.00	15.01
14	002273	水晶光电	6,869,838.00	13.90
15	600487	亨通光电	6,105,786.00	12.35
16	002245	蔚蓝锂芯	6,002,370.48	12.14
17	000060	中金岭南	5,622,614.00	11.38
18	603799	华友钴业	5,249,193.00	10.62
19	002266	浙富控股	5,187,447.00	10.50
20	600933	爱柯迪	5,106,769.00	10.33
21	002938	鹏鼎控股	5,069,111.88	10.26
22	600183	生益科技	4,971,831.00	10.06
23	002841	视源股份	4,936,874.00	9.99
24	002020	京新药业	4,803,997.00	9.72
25	603993	洛阳钼业	4,773,785.00	9.66
26	300409	道氏技术	4,693,771.00	9.50
27	000969	安泰科技	4,586,275.00	9.28
28	000063	中兴通讯	4,485,588.00	9.08
29	000725	京东方 A	4,426,332.00	8.96
30	688516	奥特维	4,384,087.42	8.87
31	000811	冰轮环境	4,349,112.00	8.80
32	603979	金诚信	4,328,715.00	8.76
33	603259	药明康德	4,327,055.00	8.76
34	601088	中国神华	4,318,306.00	8.74
35	300274	阳光电源	4,316,805.00	8.73
36	002532	天山铝业	4,301,708.00	8.70
37	601168	西部矿业	4,192,097.65	8.48

38	600985	淮北矿业	4,110,553.00	8.32
39	601677	明泰铝业	4,019,489.00	8.13
40	300017	网宿科技	3,936,918.00	7.97
41	601918	新集能源	3,847,240.00	7.78
42	002947	恒铭达	3,841,010.00	7.77
43	000975	山金国际	3,825,154.00	7.74
44	002236	大华股份	3,712,767.00	7.51
45	002056	横店东磁	3,704,416.00	7.50
46	600499	科达制造	3,619,392.00	7.32
47	002080	中材科技	3,536,117.00	7.15
48	300207	欣旺达	3,470,989.00	7.02
49	002250	联化科技	3,438,722.00	6.96
50	000960	锡业股份	3,355,837.00	6.79
51	600739	辽宁成大	3,287,479.00	6.65
52	605117	德业股份	3,240,837.00	6.56
53	600886	国投电力	3,198,310.00	6.47
54	601872	招商轮船	3,185,833.00	6.45
55	601018	宁波港	3,132,270.00	6.34
56	600196	复星医药	3,122,920.00	6.32
57	600219	南山铝业	3,113,243.00	6.30
58	600547	山东黄金	3,069,878.00	6.21
59	002048	宁波华翔	3,014,777.00	6.10
60	300750	宁德时代	2,975,678.00	6.02
61	600019	宝钢股份	2,962,718.00	5.99
62	600642	申能股份	2,960,453.00	5.99
63	002756	永兴材料	2,951,618.00	5.97
64	601988	中国银行	2,909,377.00	5.89
65	601717	中创智领	2,886,815.00	5.84
66	600025	华能水电	2,844,657.00	5.76
67	601699	潞安环能	2,789,893.00	5.64
68	600498	烽火通信	2,774,330.00	5.61

69	600741	华域汽车	2,706,783.00	5.48
70	002120	韵达股份	2,703,259.00	5.47
71	601998	中信银行	2,685,493.00	5.43
72	300919	中伟新材	2,649,028.00	5.36
73	600704	物产中大	2,602,155.00	5.27
74	601577	长沙银行	2,560,183.00	5.18
75	300442	润泽科技	2,547,706.00	5.15
76	000983	山西焦煤	2,525,992.00	5.11
77	000776	广发证券	2,508,824.00	5.08
78	603948	建业股份	2,504,415.00	5.07
79	600873	梅花生物	2,449,078.00	4.96
80	600026	中远海能	2,396,829.00	4.85
81	600309	万华化学	2,384,679.00	4.82
82	300677	英科医疗	2,316,580.00	4.69
83	000887	中鼎股份	2,214,198.00	4.48
84	002545	东方铁塔	2,138,165.00	4.33
85	002074	国轩高科	2,136,107.00	4.32
86	601975	招商南油	2,057,178.00	4.16
87	000987	越秀资本	2,052,934.00	4.15
88	000423	东阿阿胶	2,051,507.00	4.15
89	002352	顺丰控股	2,020,317.00	4.09
90	600346	恒力石化	1,972,687.00	3.99
91	002429	兆驰股份	1,965,952.00	3.98
92	002517	恺英网络	1,944,266.00	3.93
93	600531	豫光金铅	1,898,254.00	3.84
94	002064	华峰化学	1,879,638.00	3.80
95	002911	佛燃能源	1,819,179.00	3.68
96	601899	紫金矿业	1,798,041.00	3.64
97	300390	天华新能	1,774,781.00	3.59
98	600699	均胜电子	1,773,849.00	3.59
99	600023	浙能电力	1,771,350.00	3.58

100	600660	福耀玻璃	1,718,921.00	3.48
101	000686	东北证券	1,703,315.00	3.45
102	002833	弘亚数控	1,693,254.00	3.43
103	000778	新兴铸管	1,666,233.00	3.37
104	000967	盈峰环境	1,664,410.00	3.37
105	600926	杭州银行	1,659,939.00	3.36
106	600970	中材国际	1,654,183.00	3.35
107	002203	海亮股份	1,649,538.00	3.34
108	000651	格力电器	1,599,140.00	3.24
109	300230	永利股份	1,588,194.00	3.21
110	600595	中孚实业	1,522,036.00	3.08
111	300628	亿联网络	1,498,044.00	3.03
112	000034	神州数码	1,486,092.00	3.01
113	000404	长虹华意	1,483,543.50	3.00
114	601567	三星电气	1,468,076.00	2.97
115	000951	中国重汽	1,451,885.00	2.94
116	002237	恒邦股份	1,446,570.00	2.93
117	300724	捷佳伟创	1,444,483.00	2.92
118	601128	常熟银行	1,439,613.56	2.91
119	600502	安徽建工	1,431,050.00	2.90
120	603699	纽威股份	1,382,589.00	2.80
121	600011	华能国际	1,367,780.00	2.77
122	000612	焦作万方	1,360,805.00	2.75
123	600742	富维股份	1,360,721.00	2.75
124	601231	环旭电子	1,339,279.00	2.71
125	600166	福田汽车	1,328,757.00	2.69
126	605599	菜百股份	1,314,501.00	2.66
127	000933	神火股份	1,310,169.00	2.65
128	600801	华新建材	1,305,641.00	2.64
129	600999	招商证券	1,299,699.00	2.63
130	603929	亚翔集成	1,287,983.00	2.61

131	000001	平安银行	1,282,812.00	2.60
132	600031	三一重工	1,280,564.00	2.59
133	000923	河钢资源	1,277,767.00	2.59
134	600482	中国动力	1,261,434.00	2.55
135	600352	浙江龙盛	1,259,080.00	2.55
136	000895	双汇发展	1,233,206.00	2.50
137	002202	金风科技	1,227,332.00	2.48
138	600690	海尔智家	1,225,372.00	2.48
139	002648	卫星化学	1,137,150.00	2.30
140	000581	威孚高科	1,134,398.00	2.30
141	603187	海容冷链	1,133,518.00	2.29
142	000543	皖能电力	1,130,740.00	2.29
143	600177	雅戈尔	1,127,410.00	2.28
144	600483	福能股份	1,120,026.00	2.27
145	600282	南钢股份	1,107,044.00	2.24
146	603995	甬金股份	1,093,917.00	2.21
147	600496	精工钢构	1,088,401.00	2.20
148	000050	深天马 A	1,086,616.00	2.20
149	601939	建设银行	1,065,785.00	2.16
150	600761	安徽合力	1,059,257.00	2.14
151	601225	陕西煤业	1,055,628.00	2.14
152	300979	华利集团	1,047,411.00	2.12
153	001286	陕西能源	1,035,748.00	2.10
154	601166	兴业银行	1,033,800.00	2.09
155	000848	承德露露	1,029,104.40	2.08
156	300433	蓝思科技	1,028,526.00	2.08
157	000733	振华科技	1,028,311.00	2.08
158	000559	万向钱潮	1,027,206.00	2.08
159	002493	荣盛石化	1,025,173.00	2.07
160	600027	华电国际	1,024,906.00	2.07

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002008	大族激光	12,392,045.00	25.07
2	600114	东睦股份	11,657,603.00	23.59
3	603588	高能环境	10,949,208.76	22.15
4	002706	良信股份	10,319,184.00	20.88
5	601609	金田股份	10,202,008.34	20.64
6	601138	工业富联	9,975,160.00	20.18
7	002558	巨人网络	9,435,400.00	19.09
8	688772	珠海冠宇	8,647,550.38	17.50
9	002273	水晶光电	8,610,114.00	17.42
10	600549	厦门钨业	8,265,449.84	16.72
11	600933	爱柯迪	6,830,499.00	13.82
12	600487	亨通光电	6,706,110.00	13.57
13	002245	蔚蓝锂芯	6,490,510.00	13.13
14	603259	药明康德	6,298,383.00	12.74
15	000725	京东方 A	5,650,185.00	11.43
16	600183	生益科技	5,603,921.00	11.34
17	002396	星网锐捷	5,566,320.92	11.26
18	301219	腾远钴业	5,269,090.40	10.66
19	600026	中远海能	5,245,686.00	10.61
20	603979	金诚信	5,197,803.00	10.52
21	601872	招商轮船	4,998,941.59	10.11
22	000063	中兴通讯	4,830,621.00	9.77
23	000811	冰轮环境	4,791,393.00	9.69

24	002266	浙富控股	4,729,674.00	9.57
25	300274	阳光电源	4,623,136.00	9.35
26	002020	京新药业	4,499,550.00	9.10
27	002841	视源股份	4,182,343.33	8.46
28	000060	中金岭南	4,169,892.00	8.44
29	002415	海康威视	4,164,052.00	8.43
30	601088	中国神华	4,143,618.00	8.38
31	600985	淮北矿业	4,133,708.00	8.36
32	601918	新集能源	4,096,361.00	8.29
33	601677	明泰铝业	4,069,644.00	8.23
34	002056	横店东磁	4,050,131.00	8.19
35	603993	洛阳钼业	4,032,368.00	8.16
36	600642	申能股份	3,879,372.00	7.85
37	300409	道氏技术	3,588,987.00	7.26
38	600019	宝钢股份	3,497,582.80	7.08
39	002074	国轩高科	3,442,439.00	6.97
40	002938	鹏鼎控股	3,410,834.00	6.90
41	605117	德业股份	3,367,259.60	6.81
42	601168	西部矿业	3,366,654.00	6.81
43	601018	宁波港	3,343,793.00	6.77
44	300017	网宿科技	3,341,010.00	6.76
45	300207	欣旺达	3,322,084.00	6.72
46	000960	锡业股份	3,265,780.00	6.61
47	600309	万华化学	3,097,251.00	6.27
48	300750	宁德时代	3,085,023.00	6.24
49	300073	当升科技	3,049,953.00	6.17
50	600739	辽宁成大	3,048,734.00	6.17
51	600886	国投电力	3,043,303.00	6.16
52	600741	华域汽车	3,040,962.00	6.15
53	002048	宁波华翔	3,001,816.00	6.07
54	601699	潞安环能	2,998,567.00	6.07

55	600196	复星医药	2,943,849.00	5.96
56	002080	中材科技	2,904,143.00	5.88
57	600499	科达制造	2,893,508.00	5.85
58	601988	中国银行	2,864,409.00	5.80
59	600704	物产中大	2,774,157.00	5.61
60	600025	华能水电	2,773,201.00	5.61
61	603799	华友钴业	2,732,184.00	5.53
62	002120	韵达股份	2,706,161.00	5.48
63	601998	中信银行	2,662,293.00	5.39
64	601717	中创智领	2,645,355.00	5.35
65	600873	梅花生物	2,593,884.00	5.25
66	300442	润泽科技	2,504,741.00	5.07
67	000983	山西焦煤	2,403,516.00	4.86
68	002250	联化科技	2,370,675.00	4.80
69	300677	英科医疗	2,333,820.00	4.72
70	601577	长沙银行	2,226,744.00	4.51
71	000887	中鼎股份	2,192,821.00	4.44
72	000969	安泰科技	2,130,973.00	4.31
73	002429	兆驰股份	2,064,170.00	4.18
74	601975	招商南油	2,063,134.00	4.17
75	002352	顺丰控股	1,995,068.00	4.04
76	600531	豫光金铅	1,973,596.00	3.99
77	000423	东阿阿胶	1,972,394.00	3.99
78	603920	世运电路	1,951,713.00	3.95
79	002532	天山铝业	1,931,818.00	3.91
80	600346	恒力石化	1,910,644.00	3.87
81	600498	烽火通信	1,882,594.00	3.81
82	601899	紫金矿业	1,860,326.00	3.76
83	603948	建业股份	1,851,608.00	3.75
84	000776	广发证券	1,847,296.00	3.74
85	300390	天华新能	1,839,941.00	3.72

86	603699	纽威股份	1,812,168.00	3.67
87	002236	大华股份	1,788,880.00	3.62
88	600660	福耀玻璃	1,781,773.00	3.61
89	600023	浙能电力	1,767,825.00	3.58
90	600699	均胜电子	1,733,083.00	3.51
91	002773	康弘药业	1,710,123.00	3.46
92	000975	山金国际	1,697,959.00	3.44
93	000967	盈峰环境	1,661,131.00	3.36
94	000686	东北证券	1,640,941.00	3.32
95	000987	越秀资本	1,639,997.00	3.32
96	000778	新兴铸管	1,631,307.00	3.30
97	000651	格力电器	1,583,059.00	3.20
98	002203	海亮股份	1,549,097.00	3.13
99	002064	华峰化学	1,535,770.00	3.11
100	600166	福田汽车	1,508,204.00	3.05
101	000612	焦作万方	1,501,813.00	3.04
102	600219	南山铝业	1,437,832.00	2.91
103	000034	神州数码	1,436,227.20	2.91
104	601128	常熟银行	1,435,057.78	2.90
105	000951	中国重汽	1,408,081.00	2.85
106	600011	华能国际	1,386,699.00	2.81
107	002517	恺英网络	1,386,657.00	2.81
108	600482	中国动力	1,349,459.00	2.73
109	601137	博威合金	1,326,766.00	2.68
110	300919	中伟新材	1,318,248.00	2.67
111	002756	永兴材料	1,302,572.00	2.64
112	601567	三星电气	1,295,558.00	2.62
113	300433	蓝思科技	1,283,377.00	2.60
114	000895	双汇发展	1,279,830.00	2.59
115	001286	陕西能源	1,268,353.00	2.57
116	002237	恒邦股份	1,240,239.00	2.51

117	002202	金风科技	1,238,207.00	2.51
118	600031	三一重工	1,226,071.00	2.48
119	600352	浙江龙盛	1,159,726.00	2.35
120	600282	南钢股份	1,135,689.00	2.30
121	002648	卫星化学	1,131,639.00	2.29
122	600926	杭州银行	1,131,637.00	2.29
123	000783	长江证券	1,110,869.00	2.25
124	600483	福能股份	1,093,707.00	2.21
125	601225	陕西煤业	1,090,307.00	2.21
126	601633	长城汽车	1,087,908.39	2.20
127	600982	宁波能源	1,087,425.00	2.20
128	600177	雅戈尔	1,084,598.00	2.19
129	000581	威孚高科	1,082,348.00	2.19
130	300628	亿联网络	1,075,709.00	2.18
131	600690	海尔智家	1,073,942.00	2.17
132	000559	万向钱潮	1,070,714.00	2.17
133	603995	甬金股份	1,069,532.00	2.16
134	600801	华新建材	1,056,806.00	2.14
135	601939	建设银行	1,056,252.00	2.14
136	601877	正泰电器	1,046,246.00	2.12
137	600761	安徽合力	1,035,919.00	2.10
138	000733	振华科技	1,018,167.00	2.06
139	000050	深天马 A	1,013,704.00	2.05
140	600970	中材国际	1,012,772.00	2.05
141	000404	长虹华意	1,007,106.00	2.04
142	003816	中国广核	1,001,891.00	2.03
143	603611	诺力股份	997,141.00	2.02
144	600027	华电国际	995,829.00	2.01
145	300979	华利集团	990,608.00	2.00

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	611,007,544.66
卖出股票收入（成交）总额	562,329,620.35

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	5,643,670.80	5.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,643,670.80	5.35

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019827	26国债01	31,000	3,120,093.95	2.96
2	019792	25国债19	22,000	2,223,083.12	2.11
3	019835	26国债09	3,000	300,493.73	0.29

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,460.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,460.85

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

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
博道 大盘 价值 股票A	196	183,467.18	31,863,880.00	88.6 1%	4,095,687.71	11.39%
博道 大盘 价值 股票C	342	168,357.50	51,166,633.73	88.8 6%	6,411,629.98	11.14%
合计	524	178,507.31	83,030,513.73	88.7 7%	10,507,317.69	11.23%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025年07月01日-2026年06月30日）
盈利投资者数量占比	91.10%

8.3 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	博道大盘价值股票A	260,578.24	0.72%
	博道大盘价值股票C	110.00	0.00%
	合计	260,688.24	0.28%

8.4 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	博道大盘价值股票A	10~50
	博道大盘价值股票C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	博道大盘价值股票A	0
	博道大盘价值股票C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道大盘价值股票A	博道大盘价值股票C
基金合同生效日(2024年12月03日)基金份额总额	43,636,462.17	197,731,601.26
本报告期期初基金份额总额	36,106,210.70	10,802,636.80
本报告期基金总申购份额	2,642,358.93	61,867,479.48
减：本报告期基金总赎回份额	2,789,001.92	15,091,852.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	35,959,567.71	57,578,263.71

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普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。自本基金基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通证券	1	163,752,559.53	13.96%	71,387.53	14.05%	-
兴业证券	1	284,559,589.55	24.25%	124,052.77	24.41%	-
东吴证券	2	579,629,712.00	49.40%	249,441.70	49.08%	-
中泰证券	2	145,395,303.93	12.39%	63,390.25	12.47%	-

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
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	200,043.00	4.53%	400,000.00	1.86%	-	-	-	-
东吴证券	11,939.41	0.27%	-	-	-	-	-	-
中泰证券	4,201,160.00	95.20%	21,122,000.00	98.14%	-	-	-	-

注：

- 1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；
- 2、基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，财务状况良好；
- (2) 具备良好的合规风控能力，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；
- (4) 具有较强的全方位金融服务及研究能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面。

3、基金交易单元的选择程序如下：

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

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2026-01-22
2	博道大盘价值股票型证券投资基金2025年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-22
3	博道基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
4	博道基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2026-03-31
5	博道大盘价值股票型证券投资基金2025年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
6	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2026-04-22
7	博道大盘价值股票型证券投资基金2026年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-22

8	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 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260101 - 20260630	31,863,880.00	-	-	31,863,880.00	34.07%
	2	20260312 - 20260630	-	22,188,692.64	-	22,188,692.64	23.72%
产品特有风险							
本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道大盘价值股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道大盘价值股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道大盘价值股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道大盘价值股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道大盘价值股票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、报告期内博道大盘价值股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 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