

博道久航混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:兴业证券股份有限公司

送出日期:2021 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，并由董事长签发。

基金托管人兴业证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月30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2021年01月01日起至2021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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	62
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	62
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	62
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	62
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
10.8 其他重大事件.....	67
§11 备查文件目录.....	68
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	博道久航混合型证券投资基金	
基金简称	博道久航混合	
基金主代码	008318	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年12月24日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	兴业证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	355,019,456.55份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道久航混合A	博道久航混合C
下属分级基金的交易代码	008318	008319
报告期末下属分级基金的份额总额	249,929,409.21份	105,090,047.34份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	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，确定和调整资产配置比例，根据对市场环境以及股票估值、成长、盈利能力、营运质量、事件性因素、价量特征等因子表现的判断挑选个股构建股票组合，根据对利率、经济周期、宏观政策等因素的分析构建债券组合。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博道基金管理有限公司	兴业证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛	李少峰
	联系电话	021-80226288	021-20370710
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	disclosure_xztg@xyzq.com.cn
客户服务电话		400-085-2888	95562
传真		021-80226289	0591-38507797
注册地址		上海市虹口区东大名路687号1幢262室	福州市湖东路268号证券大厦
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	上海浦东新区长柳路36号兴业证券大厦11楼
邮政编码		200122	200135
法定代表人		莫泰山	杨华辉

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.bdfund.cn
基金中期报告备置地点	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 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	博道久航混合A	博道久航混合C
本期已实现收益	49,527,251.56	20,514,793.59
本期利润	24,663,388.32	11,653,620.07
加权平均基金份额本期利润	0.0835	0.0946
本期加权平均净值利润率	5.92%	6.75%
本期基金份额净值增长率	6.21%	5.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	118,916,870.99	48,824,888.67
期末可供分配基金份额利润	0.4758	0.4646
期末基金资产净值	368,846,280.20	153,914,936.01
期末基金份额净值	1.4758	1.4646
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	47.58%	46.46%

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

博道久航混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	2.63%	0.89%	-1.01%	0.62%	3.64%	0.27%
过去三个月	9.13%	0.88%	3.94%	0.71%	5.19%	0.17%
过去六个月	6.21%	1.26%	1.85%	0.97%	4.36%	0.29%
过去一年	34.38%	1.27%	19.04%	1.03%	15.34%	0.24%
自基金合同 生效起至今	47.58%	1.25%	27.15%	1.09%	20.43%	0.16%

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。
博道久航混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	2.59%	0.89%	-1.01%	0.62%	3.60%	0.27%
过去三个月	9.00%	0.88%	3.94%	0.71%	5.06%	0.17%
过去六个月	5.95%	1.26%	1.85%	0.97%	4.10%	0.29%
过去一年	33.72%	1.27%	19.04%	1.03%	14.68%	0.24%
自基金合同 生效起至今	46.46%	1.25%	27.15%	1.09%	19.31%	0.16%

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

博道久航混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年12月24日-2021年06月30日)



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。

博道久航混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年12月24日-2021年06月30日)



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。截至报告期末，公司旗下发行并管理了19只公募基金：博道启航混合型证券投资基金、博道卓远混合型证券投资基金、博道中证500指数增强型证券投资基金、博道沪深300指数增强型证券投资基金、博道远航混合型证券投资基金、博道叁佰智航股票型证券投资基金、博道志远混合型证券投资基金、博道伍佰智航股票型证券投资基金、博道嘉泰回报混合型证券投资基金、博道久航混合型证券投资基金、博道嘉瑞混合型证券投资基金、博道安远6个月定期开放混合型证券投资基金、博道嘉元混合型证券投资基金、博道嘉兴一年持有期混合型证券投资基金、博道睿见一年持有期混合型证券投资基金、博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金、博道嘉丰混合型证券投资基金、博道消费智航股票型证券投资基金和博道盛彦混合型证券投资基金。

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	博道启航混合、博道中证500增强、博道沪深300增强、博道远航混合、博道叁佰智航、博道伍佰智航、博道久航混合、博道消费智航的基金经理、研究部副总经理	2019-12-24	-	10年	杨梦女士，中国籍，经济学硕士。2011年7月至2014年6月担任农银汇理基金管理有限公司量化研究员，2014年6月至2014年11月担任华泰资产管理有限公司量化研究员，2014年1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，现任研究部

					<p>副总经理。具有基金从业资格。自2018年8月10日起担任博道启航混合型证券投资基金基金经理至今、自2019年1月3日起担任博道中证500指数增强型证券投资基金基金经理至今、自2019年4月26日起担任博道沪深300指数增强型证券投资基金基金经理至今、自2019年4月30日起担任博道远航混合型证券投资基金基金经理至今、自2019年6月5日起担任博道叁佰智航股票型证券投资基金基金经理至今、自2019年9月26日起担任博道伍佰智航股票型证券投资基金基金经理至今、自2019年12月24日起担任博道久航混合型证券投资基金基金经理至今、自2021年5月7日起担任博道消费智航股票型证券投资基金基金经理至今。</p>
--	--	--	--	--	---

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《证券业从业人员资格管理办法》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循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，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2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

2021年上半年，国内经济受到疫情散发和春节假期的影响有所波动，但结构不平衡在二季度开始有所收敛，“需求（消费、就业）恢复，生产降温”。此外，市场对通胀的关注度明显提升，一季度通胀预期升温对市场产生明显冲击，但在国内外二季度政策偏鸽派的背景下，市场有所修复。整体来看，沪深300上涨0.24%，中证500上涨6.93%，创业板指数上涨17.22%。从行业来看，电气设备、钢铁、化工等涨幅居前，家用电器、非银金融、国防军工等下跌明显。从因子表现来看，上半年市场经历了两次大的风格切换，春节前基本面类表现比较好，春节后估值量价因子出现大幅反弹，而在二季度，则是基本面类因子维持持续强势。

从经济基本面看，我国去年四季度GDP同比增长6.5%，超市场预期且超过潜在增速水平，但整体结构不平衡仍然明显，这种不平衡在一季度有所延续，但二季度开始逐渐步入收敛态势，出口和投资仍保持韧性，消费就业持续改善。通胀方面，在全球经济复苏的背景下，尤其是一季度疫苗和美国财政刺激落地后，美国疫情后经济快速复苏的趋势逐渐明朗，大宗商品价格显著上涨，全球流动性收紧预期有所强化，美债收益率快速上行，对全球长久期资产估值形成压制，股市风格从前期的极致转向均衡。但到二季度，由于就业数据低于预期，市场对QE Taper提前到来的担忧有所减轻，市场明显修复。展望后续，美国通胀上行风险较大，群体免疫和救助退坡将加速美国就业修复，美联储三季度引导QE Taper的概率较大，而国内通胀相对可控，虽然二季度单月PPI突破9%，但

主要是由于低基数和疫情供需缺口，政府以保供作为抑制大宗商品价格的抓手，短期流动性仍将处于相对宽松状态。

报告期间，本基金维持配置中证800多因子选股增强模型（不受指数成分股占比约束的版本），产品在本报告期间获得了超越业绩比较基准的业绩。

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，货币政策在信用上的“正常化”逐渐步入尾声，后续预计以稳为主，意味着估值收缩的压力相对可控；央行7月15日全面降准释放长期资金约1万亿元，同时缩量续作MLF，此次续作维持操作利率不变，表明货币政策也并未真正转向宽松。同时，政府债券发行明显后置，在经济尤其是外需较为强劲的背景下，政府“弹药留足”，下半年财政腾挪空间较大，经济大幅下行概率不大，意味着企业盈利仍有支撑。

本基金将继续坚持量化多因子的选股思路，秉持勤勉尽责，力争为投资者获得有竞争力的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期内无需预警说明。

§ 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

本次报告期内，基金托管人兴业证券股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规的规定，遵守基金合同和托管协议的约定，勤勉尽责履行基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本次报告期内，基金托管人根据相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作符合基金合同的约定。

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

本托管人认真复核了中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：博道久航混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	31,964,951.66	36,604,041.27
结算备付金		3,304.48	3,284.53

存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	495,143,468.63	720,370,778.93
其中：股票投资		469,143,468.63	683,374,478.93
基金投资		-	-
债券投资		26,000,000.00	36,996,300.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	541,755.90	824,572.86
应收股利		-	-
应收申购款		334,261.94	105,722.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		527,987,742.61	757,908,400.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,292,619.94	19,921,349.56
应付管理人报酬		649,067.48	992,882.63
应付托管费		108,177.91	165,480.42
应付销售服务费		61,860.62	111,741.73
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	114,800.45	257,522.44
负债合计		5,226,526.40	21,448,976.78
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	355,019,456.55	530,955,368.79
未分配利润	6.4.7.10	167,741,759.66	205,504,054.95
所有者权益合计		522,761,216.21	736,459,423.74
负债和所有者权益总计		527,987,742.61	757,908,400.52

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：博道久航混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
一、收入		47,812,375.15	146,756,522.91
1. 利息收入		460,500.20	2,759,017.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	157,157.69	1,572,866.46
债券利息收入		303,342.46	149,609.58
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		0.05	1,036,541.78
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		80,857,391.18	57,791,716.25

其中：股票投资收益	6.4.7.12	77,175,418.01	34,493,055.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13.2	-217,776.17	-105,735.52
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	11,527,359.22
股利收益	6.4.7.15	3,899,749.34	11,877,036.75
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-33,725,036.76	85,407,425.90
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	219,520.53	798,362.94
减：二、费用		11,495,366.76	34,162,386.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,412,649.88	13,222,046.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	735,441.60	2,203,674.45
3. 销售服务费		431,641.88	1,952,388.23
4. 交易费用	6.4.7.18	5,816,454.45	16,644,176.63
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		-	41,498.51
7. 其他费用	6.4.7.19	99,178.95	98,602.14
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		36,317,008.39	112,594,136.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		36,317,008.39	112,594,136.20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博道久航混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	530,955,368.79	205,504,054.95	736,459,423.74
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	36,317,008.39	36,317,008.39
三、本期基金份额交 易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	-175,935,912.24	-74,079,303.68	-250,015,215.92
其中：1. 基金申购款	55,065,279.05	23,660,825.83	78,726,104.88
2. 基金赎回 款	-231,001,191.29	-97,740,129.51	-328,741,320.80
四、本期向基金份额 持有人分配利润产 生的基金净值变动 (净值减少以“-” 号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	355,019,456.55	167,741,759.66	522,761,216.21
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,929,027,886.06	9,449,166.63	1,938,477,052.69
二、本期经营活动产	-	112,594,136.20	112,594,136.20

生的基金净值变动数(本期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-820,172,729.23	-14,345,301.17	-834,518,030.40
其中:1.基金申购款	18,000,721.00	-216,835.34	17,783,885.66
2.基金赎回款	-838,173,450.23	-14,128,465.83	-852,301,916.06
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,108,855,156.83	107,698,001.66	1,216,553,158.49

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

博道久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[2019]2205号《关于准予博道久航混合型证券投资基金注册的批复》核准,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《博道久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1,928,396,615.02元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0751号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博道久航混合型证券投资基金基金合同》于2019年12月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,929,027,886.06份基金份额,其中认购资金利息折合631,271.04份基金份额。本基金的基金管理人为博道基金管理有限公司,基金托管人为兴业证券股份有限公司。

根据《博道久航混合型证券投资基金基金合同》和《博道久航混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资者认购/申购基金时不收取认购/申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道久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（含中小板、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、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）。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为50%–95%。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，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为中证800指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

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》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博道久航混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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2021年01月01日至2021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2021年06月30日的财务状况以及2021年01月01日至2021年06月30日止期间的经营成果和基金净值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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及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。

(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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	4,867,360.62
定期存款	-
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	27,097,591.04
合计	31,964,951.66

注：其他存款本期末余额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 2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		445,813,529.67	469,143,468.63	23,329,938.96
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	26,034,507.89	26,000,000.00	-34,507.89
	银行间市场	-	-	-
	合计	26,034,507.89	26,000,000.00	-34,507.89
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		471,848,037.56	495,143,468.63	23,295,431.07

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	2,195.54
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	3,531.86
应收结算备付金利息	1.10
应收债券利息	536,027.40
应收资产支持证券利息	-

应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	541,755.90

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,621.50
预提费用-审计费	39,671.58
预提费用-信息披露费	69,507.37
合计	114,800.45

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 博道久航混合A

金额单位：人民币元

项目 (博道久航混合A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	350,566,599.88	350,566,599.88
本期申购	42,293,579.92	42,293,579.92
本期赎回(以“-”号填列)	-142,930,770.59	-142,930,770.59
本期末	249,929,409.21	249,929,409.21

6.4.7.9.2 博道久航混合C

金额单位：人民币元

项目 (博道久航混合C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	180,388,768.91	180,388,768.91
本期申购	12,771,699.13	12,771,699.13
本期赎回(以“-”号填列)	-88,070,420.70	-88,070,420.70
本期末	105,090,047.34	105,090,047.34

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。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 博道久航混合A

单位：人民币元

项目 (博道久航混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	133,240,408.54	3,291,326.54	136,531,735.08
本期利润	49,527,251.56	-24,863,863.24	24,663,388.32
本期基金份额交易产生的变动数	-47,146,507.08	4,868,254.67	-42,278,252.41
其中：基金申购款	17,656,621.24	692,255.70	18,348,876.94
基金赎回款	-64,803,128.32	4,175,998.97	-60,627,129.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	135,621,153.02	-16,704,282.03	118,916,870.99

6.4.7.10.2 博道久航混合C

单位：人民币元

项目 (博道久航混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	67,284,976.96	1,687,342.91	68,972,319.87

本期利润	20,514,793.59	-8,861,173.52	11,653,620.07
本期基金份额交易产生的变动数	-31,991,774.02	190,722.75	-31,801,051.27
其中：基金申购款	5,806,383.86	-494,434.97	5,311,948.89
基金赎回款	-37,798,157.88	685,157.72	-37,113,000.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,807,996.53	-6,983,107.86	48,824,888.67

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	40,459.48
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	116,678.37
结算备付金利息收入	19.84
其他	-
合计	157,157.69

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	2,489,475,255.23
减：卖出股票成本总额	2,412,299,837.22
买卖股票差价收入	77,175,418.01

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
----	-------------------------------

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-217,776.17
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	-217,776.17

6.4.7.13.2 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	41,900,450.68
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	41,218,576.17
减：应收利息总额	899,650.68
买卖债券差价收入	-217,776.17

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	3,899,749.34
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,899,749.34

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-33,725,036.76
——股票投资	-33,907,496.13
——债券投资	182,459.37
——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	-33,725,036.76

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	218,910.34
转换费收入	610.19
合计	219,520.53

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	5,816,454.45
银行间市场交易费用	-
合计	5,816,454.45

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
合计	99,178.95

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 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博道基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
兴业证券 股份有限 公司	4,712,094,987.03	100.00%	13,972,063,561.26	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
兴业证券 股份有限 公司	34,040,616.80	100.00%	104,493,718.40	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期 债券回	成交金额	占当期 债券回

		购成交 总额的 比例		购成交 总额的 比例
兴业证券 股份有限 公司	1,000.00	100.00%	7,380,001,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
兴业证券 股份有限 公司	3,298,528.03	100.00%	-	-
关联方名 称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
兴业证券 股份有限 公司	9,780,689.59	100.00%	-	-

注：基金托管人受托作为本基金的证券经纪商，为本基金证券交易提供支持服务。上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,412,649.88	13,222,046.75
其中：支付销售机构的客户维护费	1,667,495.22	5,670,307.21

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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×1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	735,441.60	2,203,674.45

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%/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 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道久航混合A	博道久航混合C	合计
博道基金管理有限公司	0.00	4,341.15	4,341.15
兴业证券股份有限公司	0.00	254,129.18	254,129.18
合计	0.00	258,470.33	258,470.33
获得销售	上年度可比期间		

服务费的各关联方名称	2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道久航混合A	博道久航混合C	合计
博道基金管理有限公司	0.00	48,573.39	48,573.39
兴业证券股份有限公司	0.00	859,334.83	859,334.83
合计	0.00	907,908.22	907,908.22

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，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。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×0.50%/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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

博道久航混合A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	1,999,800.18	1,999,800.18
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	1,999,800.18	1,999,800.18
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.56%	0.18%

博道久航混合C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至 2021年06月30日	2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	1,000,200.00	1,000,200.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	1,000,200.00	1,000,200.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.28%	0.09%

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。

6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

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		上年度可比期间	
	2021年01月01日至2021年06月30日		2020年01月01日至2020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
兴业证券股份有限公司	27,097,591.04	116,678.37	93,735,487.92	1,241,435.31

注：基金托管人受托作为本基金的证券经纪商。上述款项为本基金存放于基金托管人基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期
2021年01月01日至2021年06月30日

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
兴业证券股份有限公司	300941	创识科技	网下发行	3,989	85,005.59
兴业证券股份有限公司	688195	腾景科技	网下发行	2,693	36,624.80
兴业证券股份有限公司	688639	华恒生物	网下发行	2,302	53,314.32
兴业证券股份有限公司	300979	华利集团	网下发行	7,443	247,256.46
兴业证券股份有限公司	688597	煜邦电力	网下发行	3,907	22,973.16
上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额

兴业 证券 股份 有限 公司	-	-	-	-	-
----------------------------	---	---	---	---	---

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021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	可流通日	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
688425	铁建重工	2021-06-11	2021-12-22	科创板打新限售	2.87	4.75	69,535	199,565.45	330,291.25	-
688601	力芯微	2021-06-18	2021-12-28	科创板打新限售	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06	-
688667	菱电电控	2021-03-03	2021-09-13	科创板打新限售	75.42	103.88	1,191	89,825.22	123,721.08	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	创业板打新限售	47.33	251.96	450	21,298.50	113,382.00	-

300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	创业板打新限售	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
688319	欧林生物	2021-05-31	2021-12-08	科创板打新限售	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688533	上声电子	2021-04-09	2021-10-19	科创板打新限售	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	创业板打新限售	33.22	87.50	745	24,748.90	65,187.50	-
688611	杭州柯林	2021-04-01	2021-10-12	科创板打新限售	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688191	智洋创新	2021-03-30	2021-10-08	科创板打新限售	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	创业板打新限售	48.59	90.39	472	22,934.48	42,664.08	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	创业板打新限售	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
301	密封	2021-	2021-	新股未	10.	10.	3,78	40,31	40,31	-

020	科技	06-28	07-06	上市	64	64	9	4.96	4.96	
688 565	力源 科技	2021- 05-06	2021- 11-15	科创板 打新限 售	9.3 9	14. 00	2,46 4	23,13 6.96	34,49 6.00	-
688 367	工大 高科	2021- 06-21	2021- 12-28	科创板 打新限 售	11. 53	17. 94	1,71 7	19,79 7.01	30,80 2.98	-
688 681	科汇 股份	2021- 06-04	2021- 12-16	科创板 打新限 售	9.5 6	14. 54	1,89 9	18,15 4.44	27,61 1.46	-
300 941	创识 科技	2021- 02-02	2021- 08-09	创业板 打新限 售	21. 31	49. 94	399	8,50 2.69	19,92 6.06	-
301 015	百洋 医药	2021- 06-22	2021- 12-30	创业板 打新限 售	7.6 4	38. 83	462	3,52 9.68	17,93 9.46	-
688 226	威腾 电气	2021- 06-28	2021- 07-07	新股未 上市	6.4 2	6.4 2	2,69 3	17,28 9.06	17,28 9.06	-
300 932	三友 联众	2021- 01-15	2021- 07-22	创业板 打新限 售	24. 69	31. 71	492	12,14 7.48	15,60 1.32	-
300 982	苏文 电能	2021- 04-19	2021- 10-27	创业板 打新限 售	15. 83	45. 29	317	5,01 8.11	14,35 6.93	-
300 968	格林 精密	2021- 04-06	2021- 10-15	创业板 打新限 售	6.8 7	12. 07	1,16 2	7,98 2.94	14,02 5.34	-
300 940	南极 光	2021- 01-27	2021- 08-03	创业板 打新限 售	12. 76	43. 38	307	3,91 7.32	13,31 7.66	-
300 614	百川 畅银	2021- 05-18	2021- 11-25	创业板 打新限 售	9.1 9	40. 38	329	3,02 3.51	13,28 5.02	-

300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	创业板打新限售	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	创业板打新限售	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	创业板打新限售	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	创业板打新限售	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	创业板打新限售	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	创业板打新限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	创业板打新限售	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	创业板打新限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	创业板打新限售	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	创业板打新限售	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301	雷尔	2021-	2021-	创业板	13.	32.	275	3,78	9,06	-

016	伟	06-23	12-30	打新限售	75	98		1.25	9.50	
300 966	共同 药业	2021- 03-31	2021- 10-11	创业板 打新限售	8.2 4	31. 54	286	2,35 6.64	9,02 0.44	-
300 945	曼卡 龙	2021- 02-03	2021- 08-10	创业板 打新限售	4.5 6	18. 88	474	2,16 1.44	8,94 9.12	-
300 948	冠中 生态	2021- 02-18	2021- 08-25	创业板 打新限售	8.6 7	27. 42	324	2,80 8.00	8,88 4.08	-
300 931	通用 电梯	2021- 01-13	2021- 07-21	创业板 打新限售	4.3 1	13. 11	672	2,89 6.32	8,80 9.92	-
300 961	深水 海纳	2021- 03-23	2021- 09-30	创业板 打新限售	8.4 8	22. 07	394	3,34 1.12	8,69 5.58	-
300 950	德固 特	2021- 02-24	2021- 09-03	创业板 打新限售	8.4 1	39. 13	219	1,84 1.79	8,56 9.47	-
605 162	新中 港	2021- 06-29	2021- 07-07	新股未 上市	6.0 7	6.0 7	1,37 7	8,35 8.39	8,35 8.39	-
300 958	建工 修复	2021- 03-18	2021- 09-29	创业板 打新限售	8.5 3	27. 22	300	2,55 9.00	8,16 6.00	-
300 986	志特 新材	2021- 04-21	2021- 11-01	创业板 打新限售	14. 79	30. 57	264	3,90 4.56	8,07 0.48	-
300 987	川网 传媒	2021- 04-28	2021- 11-11	创业板 打新限售	6.7 9	26. 81	301	2,04 3.79	8,06 9.81	-
300 978	东箭 科技	2021- 04-15	2021- 10-26	创业板 打新限售	8.4 2	13. 60	593	4,99 3.06	8,06 4.80	-

				售						
300 926	博俊 科技	2020- 12-29	2021- 07-12	创业板 打新限 售	10. 76	22. 20	359	3,86 2.84	7,96 9.80	-
300 993	玉马 遮阳	2021- 05-17	2021- 11-24	创业板 打新限 售	12. 10	19. 29	410	4,96 1.00	7,90 8.90	-
300 985	致远 新能	2021- 04-21	2021- 10-29	创业板 打新限 售	24. 90	24. 81	295	7,34 5.50	7,31 8.95	-
300 971	博亚 精工	2021- 04-07	2021- 10-15	创业板 打新限 售	18. 24	28. 29	245	4,46 8.80	6,93 1.05	-
301 004	嘉益 股份	2021- 06-18	2021- 12-27	创业板 打新限 售	7.8 1	21. 94	312	2,43 6.72	6,84 5.28	-
300 991	创益 通	2021- 05-12	2021- 11-22	创业板 打新限 售	13. 06	26. 51	254	3,31 7.24	6,73 3.54	-
300 927	江天 化学	2020- 12-29	2021- 07-07	创业板 打新限 售	13. 39	30. 10	217	2,90 5.63	6,53 1.70	-
301 018	申菱 环境	2021- 06-28	2022- 01-07	创业板 打新限 售	8.2 9	8.2 9	782	6,48 2.78	6,48 2.78	-
300 975	商络 电子	2021- 04-14	2021- 10-21	创业板 打新限 售	5.4 8	13. 03	492	2,69 6.16	6,41 0.76	-
300 963	中洲 特材	2021- 03-30	2021- 10-11	创业板 打新限 售	12. 13	22. 49	283	3,43 2.79	6,36 4.67	-
301 011	华立 科技	2021- 06-09	2021- 12-17	创业板 打新限	14. 20	33. 84	175	2,48 5.00	5,92 2.00	-

				售						
300 943	春晖 智控	2021- 02-03	2021- 08-10	创业板 打新限 售	9.7 9	23. 01	255	2,49 6.45	5,86 7.55	-
300 967	晓鸣 股份	2021- 04-02	2021- 10-13	创业板 打新限 售	4.5 4	11. 54	507	2,30 1.78	5,85 0.78	-
300 972	万辰 生物	2021- 04-08	2021- 10-19	创业板 打新限 售	7.1 9	12. 65	430	3,09 1.70	5,43 9.50	-
300 929	华骐 环保	2021- 01-12	2021- 07-21	创业板 打新限 售	13. 87	29. 55	183	2,53 8.21	5,40 7.65	-
300 960	通业 科技	2021- 03-22	2021- 09-29	创业板 打新限 售	12. 08	23. 06	234	2,82 6.72	5,39 6.04	-
301 020	密封 科技	2021- 06-28	2022- 01-06	创业板 打新限 售	10. 64	10. 64	421	4,47 9.44	4,47 9.44	-
300 995	奇德 新材	2021- 05-17	2021- 11-26	创业板 打新限 售	14. 72	23. 32	191	2,81 1.52	4,45 4.12	-
301 007	德迈 仕	2021- 06-04	2021- 12-16	创业板 打新限 售	5.2 9	14. 44	303	1,60 2.87	4,37 5.32	-
300 998	宁波 方正	2021- 05-25	2021- 12-02	创业板 打新限 售	6.0 2	21. 32	201	1,21 0.02	4,28 5.32	-
301 012	扬电 科技	2021- 06-15	2021- 12-22	创业板 打新限 售	8.0 5	24. 26	170	1,36 8.50	4,12 4.20	-
300 992	泰福 泵业	2021- 05-17	2021- 11-25	创业板 打新限	9.3 6	20. 32	200	1,87 2.00	4,06 4.00	-

				售						
301 010	晶雪 节能	2021- 06-09	2021- 12-20	创业板 打新限 售	7.8 3	17. 61	218	1,70 6.94	3,83 8.98	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让；

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期；

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688 368	晶 丰 明 源	202 1-0 6-2 1	重 大 事 项	33 5.2 6	202 1-0 7-0 5	40 2.3 1	12,289	3,969,30 0.14	4,120,01 0.14	-

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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放于具有基金托管资格的兴业银行股份有限公司，其他存款存放于兴业证券，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，违约风险可能性很小；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2021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（2020年12月31日：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于2021年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)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期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2021年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为1.17%。

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2021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517,542,830.97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 2021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							
银行存款	31,964,951.66	-	-	-	-	-	31,964,951.66
结算备付金	3,304.48	-	-	-	-	-	3,304.48
交易性金融资产	26,000,000.00	-	-	-	-	469,143,468.63	495,143,468.63
应收利息	-	-	-	-	-	541,755.90	541,755.90
应收申购款	-	-	-	-	-	334,261.94	334,261.94
资产总计	57,968,256.14	0.00	0.00	0.00	0.00	470,019,486.47	527,987,742.61
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,292,619.94	4,292,619.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	649,067.48	649,067.48
应付托管费	-	-	-	-	-	108,177.91	108,177.91
应付销售服务费	-	-	-	-	-	61,860.62	61,860.62

其他负债	-	-	-	-	-	114,800.45	114,800.45
负债总计	-	-	-	-	-	5,226,526.40	5,226,526.40
利率敏感度缺口	57,968,256.14	0.00	0.00	0.00	0.00	464,792,960.07	522,761,216.21
上年度末 2020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							
银行存款	36,604,041.27	-	-	-	-	-	36,604,041.27
结算备付金	3,284.53	-	-	-	-	-	3,284.53
交易性金融资产	36,996,300.00	-	-	-	-	683,374,478.93	720,370,778.93
应收利息	-	-	-	-	-	824,572.86	824,572.86
应收申购款	-	-	-	-	-	105,722.93	105,722.93
资产总计	73,603,625.80	-	-	-	-	684,304,774.72	757,908,400.52
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	19,921,349.56	19,921,349.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	992,882.63	992,882.63
应付托管费	-	-	-	-	-	165,480.42	165,480.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-	111,741.73	111,741.73
其他负债	-	-	-	-	-	257,522.44	257,522.44
负债总计	-	-	-	-	-	21,448,976.78	21,448,976.78
利率敏感度缺口	73,603,625.80	-	-	0.00	-	662,855,797.94	736,459,423.74

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2021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资产净值的比例为4.97%(2020年12月31日：5.02%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020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占基金资产的50%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，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 2021年06月30日		上年度末 2020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	469,143,468.63	89.74	683,374,478.93	92.79

产—股票投资				
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	469,143,468.63	89.74	683,374,478.93	92.79

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证800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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 中证800指数收益率上升5%	24,950,541.57	34,324,565.69
	2. 中证800指数收益率下降5%	-24,950,541.57	-34,324,565.69

6.4.14 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	469,143,468.63	88.85
	其中：股票	469,143,468.63	88.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	26,000,000.00	4.92
	其中：债券	26,000,000.00	4.92
	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	31,968,256.14	6.05
8	其他各项资产	876,017.84	0.17
9	合计	527,987,742.61	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	3,509,656.68	0.67
B	采矿业	10,908,099.98	2.09
C	制造业	300,670,935.80	57.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,614,136.43	0.50
E	建筑业	2,139,371.37	0.41
F	批发和零售业	3,175,324.10	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	7,923,175.44	1.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,051,939.19	4.03
J	金融业	98,420,914.59	18.83

K	房地产业	4,338,379.40	0.83
L	租赁和商务服务业	5,624,474.20	1.08
M	科学研究和技术服务业	2,121,481.32	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	78,934.33	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,566,645.80	1.26
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	469,143,468.63	89.74

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

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	601318	中国平安	286,697	18,428,883.16	3.53
2	600519	贵州茅台	8,600	17,687,620.00	3.38
3	600036	招商银行	299,274	16,217,658.06	3.10
4	601166	兴业银行	584,640	12,014,352.00	2.30
5	000858	五粮液	34,100	10,158,049.00	1.94
6	000333	美的集团	131,200	9,363,744.00	1.79
7	600809	山西汾酒	17,748	7,951,104.00	1.52
8	601919	中远海控	259,436	7,923,175.44	1.52
9	000001	平安银行	319,200	7,220,304.00	1.38
10	601012	隆基股份	76,404	6,787,731.36	1.30
11	000661	长春高新	17,249	6,675,363.00	1.28
12	002142	宁波银行	152,705	5,950,913.85	1.14

13	601888	中国中免	18,742	5,624,474.20	1.08
14	600309	万华化学	51,251	5,577,133.82	1.07
15	603882	金域医学	31,700	5,064,709.00	0.97
16	600919	江苏银行	657,900	4,671,090.00	0.89
17	002920	德赛西威	40,500	4,458,240.00	0.85
18	300782	卓胜微	8,102	4,354,825.00	0.83
19	300750	宁德时代	8,100	4,331,880.00	0.83
20	603486	科沃斯	18,200	4,151,056.00	0.79
21	600030	中信证券	166,200	4,145,028.00	0.79
22	688368	晶丰明源	12,289	4,120,010.14	0.79
23	600966	博汇纸业	315,604	4,118,632.20	0.79
24	601336	新华保险	86,300	3,962,033.00	0.76
25	603010	万盛股份	187,620	3,934,391.40	0.75
26	600392	盛和资源	225,500	3,914,680.00	0.75
27	603444	吉比特	7,300	3,869,000.00	0.74
28	002876	三利谱	59,626	3,857,802.20	0.74
29	002568	百润股份	40,366	3,826,293.14	0.73
30	000977	浪潮信息	134,300	3,777,859.00	0.72
31	300458	全志科技	41,674	3,653,142.84	0.70
32	300760	迈瑞医疗	7,590	3,643,579.50	0.70
33	002240	盛新锂能	126,800	3,620,140.00	0.69
34	000651	格力电器	67,185	3,500,338.50	0.67
35	002714	牧原股份	57,520	3,498,366.40	0.67
36	601939	建设银行	524,896	3,490,558.40	0.67
37	000568	泸州老窖	14,500	3,421,130.00	0.65
38	002415	海康威视	50,655	3,267,247.50	0.62
39	002304	洋河股份	15,700	3,253,040.00	0.62
40	601857	中国石油	603,400	3,191,986.00	0.61
41	000683	远兴能源	677,600	3,164,392.00	0.61
42	603501	韦尔股份	9,700	3,123,400.00	0.60
43	300529	健帆生物	34,985	3,021,304.60	0.58

44	600426	华鲁恒升	97,320	3,012,054.00	0.58
45	600808	马钢股份	697,800	2,993,562.00	0.57
46	300751	迈为股份	6,580	2,991,926.00	0.57
47	002601	龙蟠佰利	85,500	2,956,590.00	0.57
48	601688	华泰证券	184,400	2,913,520.00	0.56
49	601699	潞安环能	241,620	2,853,532.20	0.55
50	603260	合盛硅业	36,600	2,814,906.00	0.54
51	300677	英科医疗	22,534	2,812,243.20	0.54
52	600019	宝钢股份	365,100	2,789,364.00	0.53
53	300059	东方财富	84,800	2,780,592.00	0.53
54	600459	贵研铂业	112,962	2,778,865.20	0.53
55	600895	张江高科	151,800	2,773,386.00	0.53
56	601678	滨化股份	350,445	2,772,019.95	0.53
57	002475	立讯精密	59,500	2,737,000.00	0.52
58	600584	长电科技	72,300	2,724,264.00	0.52
59	603612	索通发展	150,400	2,702,688.00	0.52
60	300496	中科创达	17,200	2,701,432.00	0.52
61	603288	海天味业	20,680	2,666,686.00	0.51
62	000725	京东方 A	421,400	2,629,536.00	0.50
63	603113	金能科技	145,317	2,624,425.02	0.50
64	603393	新天然气	142,293	2,601,116.04	0.50
65	000581	威孚高科	123,700	2,576,671.00	0.49
66	002932	明德生物	26,200	2,556,334.00	0.49
67	688399	硕世生物	14,962	2,522,593.20	0.48
68	300770	新媒股份	50,900	2,478,830.00	0.47
69	601636	旗滨集团	131,600	2,442,496.00	0.47
70	688068	热景生物	12,902	2,438,478.00	0.47
71	601288	农业银行	801,400	2,428,242.00	0.46
72	601233	桐昆股份	100,700	2,425,863.00	0.46
73	601628	中国人寿	70,724	2,396,836.36	0.46
74	688169	石头科技	1,900	2,395,900.00	0.46

75	000039	中集集团	131,100	2,383,398.00	0.46
76	000807	云铝股份	194,344	2,312,693.60	0.44
77	688298	东方生物	10,523	2,289,804.80	0.44
78	601066	中信建投	72,300	2,272,389.00	0.43
79	603267	鸿远电子	17,207	2,201,119.44	0.42
80	603659	璞泰来	16,080	2,196,528.00	0.42
81	600612	老凤祥	41,100	2,177,067.00	0.42
82	002135	东南网架	281,700	2,155,005.00	0.41
83	603259	药明康德	13,548	2,121,481.32	0.41
84	000498	山东路桥	377,500	2,114,000.00	0.40
85	688188	柏楚电子	4,797	2,091,492.00	0.40
86	601577	长沙银行	231,889	2,073,087.66	0.40
87	600183	生益科技	88,100	2,062,421.00	0.39
88	600586	金晶科技	211,800	1,971,858.00	0.38
89	603026	石大胜华	12,100	1,960,805.00	0.38
90	000799	酒鬼酒	7,600	1,942,560.00	0.37
91	002382	蓝帆医疗	93,000	1,939,050.00	0.37
92	600031	三一重工	65,500	1,904,085.00	0.36
93	300497	富祥药业	146,509	1,844,548.31	0.35
94	002709	天赐材料	16,989	1,810,687.62	0.35
95	688036	传音控股	8,493	1,779,283.50	0.34
96	300390	天华超净	36,700	1,762,701.00	0.34
97	002430	杭氧股份	50,921	1,761,357.39	0.34
98	603489	八方股份	7,445	1,759,849.10	0.34
99	300627	华测导航	51,320	1,750,525.20	0.33
100	002026	山东威达	127,300	1,738,918.00	0.33
101	002736	国信证券	161,000	1,730,750.00	0.33
102	603035	常熟汽饰	105,600	1,721,280.00	0.33
103	300748	金力永磁	54,380	1,720,039.40	0.33
104	688139	海尔生物	16,336	1,716,913.60	0.33
105	601689	拓普集团	45,800	1,714,294.00	0.33

106	600096	云天化	120,497	1,691,777.88	0.32
107	000963	华东医药	36,720	1,689,487.20	0.32
108	601898	中煤能源	235,000	1,680,250.00	0.32
109	002139	拓邦股份	93,300	1,678,467.00	0.32
110	603297	永新光学	25,500	1,677,900.00	0.32
111	002179	中航光电	21,202	1,675,382.04	0.32
112	002169	智光电气	138,100	1,668,248.00	0.32
113	002138	顺络电子	42,700	1,655,479.00	0.32
114	600779	水井坊	13,100	1,655,185.00	0.32
115	600746	江苏索普	107,300	1,645,982.00	0.31
116	002594	比亚迪	6,500	1,631,500.00	0.31
117	002106	莱宝高科	144,100	1,621,125.00	0.31
118	002661	克明面业	116,400	1,610,976.00	0.31
119	601666	平煤股份	225,800	1,605,438.00	0.31
120	300661	圣邦股份	6,350	1,604,835.50	0.31
121	601001	晋控煤业	217,203	1,576,893.78	0.30
122	601009	南京银行	149,100	1,568,532.00	0.30
123	600064	南京高科	168,460	1,564,993.40	0.30
124	002230	科大讯飞	23,100	1,561,098.00	0.30
125	300408	三环集团	36,500	1,548,330.00	0.30
126	600104	上汽集团	70,400	1,546,688.00	0.30
127	603986	兆易创新	8,160	1,533,264.00	0.29
128	000933	神火股份	161,700	1,528,065.00	0.29
129	600999	招商证券	79,200	1,506,384.00	0.29
130	300015	爱尔眼科	21,160	1,501,936.80	0.29
131	600588	用友网络	45,046	1,498,229.96	0.29
132	603806	福斯特	14,155	1,488,115.15	0.28
133	300014	亿纬锂能	14,200	1,475,806.00	0.28
134	601865	福莱特	37,300	1,474,469.00	0.28
135	600600	青岛啤酒	12,700	1,468,755.00	0.28
136	600690	海尔智家	56,671	1,468,345.61	0.28

137	002410	广联达	21,400	1,459,480.00	0.28
138	600887	伊利股份	39,338	1,448,818.54	0.28
139	300595	欧普康视	13,983	1,447,939.65	0.28
140	600499	科达制造	99,800	1,437,120.00	0.27
141	300755	华致酒行	35,200	1,436,512.00	0.27
142	603833	欧派家居	10,000	1,419,600.00	0.27
143	002460	赣锋锂业	11,700	1,416,753.00	0.27
144	603737	三棵树	8,020	1,411,520.00	0.27
145	601998	中信银行	276,000	1,407,600.00	0.27
146	603566	普莱柯	61,000	1,390,800.00	0.27
147	002028	思源电气	44,500	1,370,155.00	0.26
148	002738	中矿资源	29,300	1,300,920.00	0.25
149	002913	奥士康	16,400	1,278,380.00	0.24
150	600745	闻泰科技	13,000	1,259,700.00	0.24
151	002064	华峰化学	88,213	1,252,624.60	0.24
152	000538	云南白药	10,800	1,249,776.00	0.24
153	601901	方正证券	129,000	1,207,440.00	0.23
154	688111	金山办公	2,977	1,175,319.60	0.22
155	600276	恒瑞医药	16,860	1,145,974.20	0.22
156	688425	铁建重工	69,535	330,291.25	0.06
157	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.03
158	688667	菱电电控	1,191	123,721.08	0.02
159	300957	贝泰妮	450	113,382.00	0.02
160	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.02
161	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.02
162	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
163	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.01
164	300979	华利集团	745	65,187.50	0.01
165	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
166	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.01
167	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.01

168	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
169	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
170	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
171	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
172	300981	中红医疗	472	42,664.08	0.01
173	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
174	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
175	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.01
176	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.01
177	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.01
178	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
179	301015	N百洋	514	20,859.78	0.00
180	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
181	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
182	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
183	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
184	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
185	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
186	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
187	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
188	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
189	301013	C利和兴	471	12,768.81	0.00
190	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
191	603171	N税友	637	12,230.40	0.00
192	301016	N雷尔伟	347	12,175.58	0.00
193	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
194	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
195	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
196	300962	中金辐照	657	11,373.12	0.00
197	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
198	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00

199	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
200	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
201	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
202	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
203	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
204	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
205	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
206	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
207	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
208	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
209	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
210	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
211	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
212	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
213	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
214	300963	中洲特材	330	7,821.67	0.00
215	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
216	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
217	301004	C嘉益	312	6,845.28	0.00
218	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
219	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
220	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
221	688359	三孚新科	176	6,248.00	0.00
222	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
223	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
224	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
225	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
226	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
227	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
228	605011	N杭热	525	4,662.00	0.00
229	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00

230	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
231	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
232	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
233	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
234	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	42,039,664.00	5.71
2	600036	招商银行	34,479,464.36	4.68
3	601318	中国平安	30,844,931.49	4.19
4	000858	五粮液	26,203,454.30	3.56
5	601166	兴业银行	24,546,749.62	3.33
6	600809	山西汾酒	22,470,585.71	3.05
7	603882	金域医学	21,246,963.60	2.89
8	600309	万华化学	19,428,461.04	2.64
9	000661	长春高新	18,795,210.32	2.55
10	601012	隆基股份	18,768,326.58	2.55
11	600019	宝钢股份	17,891,992.00	2.43
12	000333	美的集团	16,919,917.78	2.30
13	603288	海天味业	16,756,975.23	2.28
14	000725	京东方A	16,560,872.00	2.25
15	000001	平安银行	16,400,094.40	2.23
16	601919	XR中远海	16,263,112.29	2.21
17	600887	伊利股份	15,823,624.86	2.15
18	000977	浪潮信息	14,573,506.48	1.98
19	002415	海康威视	14,495,557.50	1.97
20	600966	博汇纸业	14,427,850.06	1.96

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	600519	贵州茅台	51,567,037.34	7.00
2	601318	中国平安	43,815,797.64	5.95
3	600036	招商银行	41,630,965.11	5.65
4	000858	五粮液	31,492,791.20	4.28
5	601012	隆基股份	24,047,081.96	3.27
6	600309	万华化学	22,374,201.00	3.04
7	600031	三一重工	21,991,999.00	2.99
8	002415	海康威视	21,894,644.29	2.97
9	600887	伊利股份	21,865,578.97	2.97
10	600276	恒瑞医药	21,362,984.41	2.90
11	600585	海螺水泥	20,390,692.97	2.77
12	603288	海天味业	20,125,347.48	2.73
13	000651	格力电器	19,763,199.51	2.68
14	601166	兴业银行	19,562,712.40	2.66
15	000333	美的集团	19,494,897.12	2.65
16	300059	东方财富	19,184,761.68	2.60
17	000725	京东方A	18,751,620.21	2.55
18	601888	中国中免	18,274,782.40	2.48
19	600019	宝钢股份	17,909,017.44	2.43
20	002714	牧原股份	17,429,604.74	2.37
21	000002	万科A	17,218,885.72	2.34
22	000661	长春高新	16,914,871.64	2.30
23	603882	金域医学	16,878,341.60	2.29
24	002594	比亚迪	16,843,181.76	2.29

25	600809	山西汾酒	16,745,923.00	2.27
26	600900	长江电力	16,675,269.20	2.26
27	002475	立讯精密	16,463,135.84	2.24
28	601628	中国人寿	15,607,100.96	2.12
29	300760	迈瑞医疗	15,575,471.45	2.11
30	300413	芒果超媒	15,407,474.75	2.09
31	300015	爱尔眼科	15,025,932.82	2.04
32	300750	宁德时代	14,837,448.14	2.01

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	2,231,976,323.05
卖出股票收入（成交）总额	2,489,475,255.23

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	26,000,000.00	4.97
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	26,000,000.00	4.97

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	019640	20国债10	260,000	26,000,000.00	4.97

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或者在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（1）2021年5月17日，中国银保监会对招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，股票代码600036）作出行政处罚决定（银保监罚决字〔2021〕16号），因招商银

行为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等二十七条违法违规事实，处以罚款7170万元。

2020年8月31日，中国银保监会福建监管局对兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”，股票代码601166）作出行政处罚决定（闽银保监罚决字〔2020〕24号），因兴业银行同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保等行为，被给予没收违法所得6,361,807.97元，并合计处以罚款15,961,807.97元的行政处罚。2020年9月4日，中国人民银行福州中心支行对兴业银行作出行政处罚决定（福银罚字〔2020〕35号），因兴业银行为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；违反银行卡收单外包管理规定；未按规定履行客户身份识别义务，被给予警告，没收违法所得10,875,088.15元，并处13,824,431.23元罚款。2021年1月11日，中国银保监会消保局发布《关于兴业银行互联网保险销售违规问题的通报》（银保监消保发〔2021〕2号），因兴业银行通过互联网销售重疾险时未充分履行对免除保险公司责任条款的提示和明确说明义务，展示免除保险公司责任条款的单独页面内容严重缺失，互联网保险销售行为可回溯管理不健全，被给予通报批评处分。

2020年10月16日，中国银保监会宁波监管局对平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”，股票代码000001）作出行政处罚决定（甬银保监罚决字〔2020〕66号），因平安银行贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等违法违规事项，被给予合计罚款人民币100万元的行政处罚。

本基金采用量化选股策略，上述股票是根据选股模型批量选择出来的个股，由于上述事件并未影响到模型的选股指标体系，且本基金认为不会对公司的投资价值构成实质性负面影响，所以本基金遵循量化模型的选股结果，继续投资上述股票。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	541,755.90
5	应收申购款	334,261.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	876,017.84

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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 久航 混合A	5,10 2	48,986.56	48,556,362.62	19.4 3%	201,373,046.59	80.57%
博道 久航	3,50 3	30,000.01	1,700,200.00	1.62%	103,389,847.34	98.38%

混合C						
合计	8,428	42,123.81	50,256,562.62	14.16%	304,762,893.93	85.84%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博道久航混合A	9.88	0.00%
	博道久航混合C	2,370.78	0.00%
	合计	2,380.66	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道久航混合A	博道久航混合C
基金合同生效日(2019年12月24日)基金份额总额	1,054,254,547.59	874,773,338.47
本报告期期初基金份额总额	350,566,599.88	180,388,768.91
本报告期基金总申购份额	42,293,579.92	12,771,699.13
减：本报告期基金总赎回份额	142,930,770.59	88,070,420.70
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	249,929,409.21	105,090,047.34
-------------	----------------	----------------

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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	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	

	量					
兴业 证券 股份 有限 公司	2	4,712,094,987.03	100.0 0%	3,298,528.03	100.0 0%	-

10.7.2 基金租用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
兴业证券股份 有限公司	34,040,61 6.80	100.0 0%	1,00 0.00	100.0 0%	-	-	-	-

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，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
 - 2) 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；
 - 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，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交易单元的证券经营机构；
 - 2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

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	2021-01-22

2	博道久航混合型证券投资基金2020年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-01-22
3	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人承销证券的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-02-03
4	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人承销证券的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-19
5	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	2021-03-31
6	博道久航混合型证券投资基金2020年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-31
7	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人承销证券的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-15
8	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人承销证券的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-16
9	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	2021-04-22
10	博道久航混合型证券投资基金2021年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-22
11	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人承销证券的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-10
12	博道基金管理有限公司关于提醒投资者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	2021-06-18

§ 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久航混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道久航混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道久航混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道久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久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、报告期内博道久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
二〇二一年八月三十一日