

博道久航混合型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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:2023 年 03 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。本年度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2023年3月29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。

本报告期自2022年01月01日起至2022年12月31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	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	68
8.1 期末基金资产组合情况	68
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	69
8.3 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	70
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	77
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	84
8.6 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	84
8.7 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	84
8.8 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	84
8.9 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	84
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	85

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	85
8.12 投资组合报告附注.....	85
§9 基金份额持有人信息.....	86
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	86
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	87
9.3 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.....	87
§10 开放式基金份额变动.....	87
§11 重大事件揭示.....	88
11.1 基金份额持有人大会决议.....	88
11.2 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.....	88
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	88
11.4 基金投资策略的改变.....	88
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	88
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	88
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	89
11.8 其他重大事件.....	90
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	93
12.1 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.....	93
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	93
§13 备查文件目录.....	93
13.1 备查文件目录.....	93
13.2 存放地点.....	93
13.3 查阅方式.....	93

§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	216,858,036.62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	155,168,237.84份	61,689,798.78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。本基金的可转换债券和可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+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1158号301室	福建省福州市湖东路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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.bdfund.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2022年		2021年		2020年	
	博道久航混合A	博道久航混合C	博道久航混合A	博道久航混合C	博道久航混合A	博道久航混合C
本期已实现收益	-50,524,025.71	-20,195,505.61	64,006,263.70	25,523,568.17	203,082,665.54	108,809,001.22
本期利润	-56,597,565.61	-21,817,035.29	25,143,886.37	11,560,123.87	228,487,748.09	130,753,890.67
加权平均基金份额本期利润	-0.3358	-0.3161	0.1005	0.1154	0.3158	0.2528
本期加权平均净值利润率	-26.35%	-25.12%	6.99%	8.09%	28.91%	23.73%
本期基金份额净值增长率	-22.28%	-22.67%	6.18%	5.65%	38.27%	37.58%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末		2021年末		2020年末	
期末可供分配利润	22,765,818.04	7,985,417.63	87,678,694.17	32,770,133.66	133,240,408.54	67,284,976.96
期末可供分配基金份额利润	0.1467	0.1294	0.4754	0.4605	0.3801	0.3730
期末基金资产净值	177,934,055.88	69,675,216.41	272,091,147.34	103,928,726.95	487,098,334.96	249,361,088.78
期末基金份额净值	1.1467	1.1294	1.4754	1.4605	1.3895	1.3824
3.1.3 累计期末指标	2022年末		2021年末		2020年末	
基金份额累计净值增长率	14.67%	12.94%	47.54%	46.05%	38.95%	38.24%

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
过去三个月	-5.33%	1.02%	1.70%	0.95%	-7.03%	0.07%
过去六个月	-16.23%	1.00%	-9.84%	0.85%	-6.39%	0.15%
过去一年	-22.28%	1.20%	-16.60%	1.01%	-5.68%	0.19%
过去三年	14.11%	1.20%	1.81%	1.02%	12.30%	0.18%
自基金合同生效起至今	14.67%	1.20%	4.58%	1.02%	10.09%	0.18%

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
过去三个月	-5.45%	1.02%	1.70%	0.95%	-7.15%	0.07%
过去六个月	-16.45%	1.00%	-9.84%	0.85%	-6.61%	0.15%
过去一年	-22.67%	1.20%	-16.60%	1.01%	-6.07%	0.19%
过去三年	12.40%	1.20%	1.81%	1.02%	10.59%	0.18%
自基金合同生效起至今	12.94%	1.20%	4.58%	1.02%	8.36%	0.18%

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-2022年12月31日)



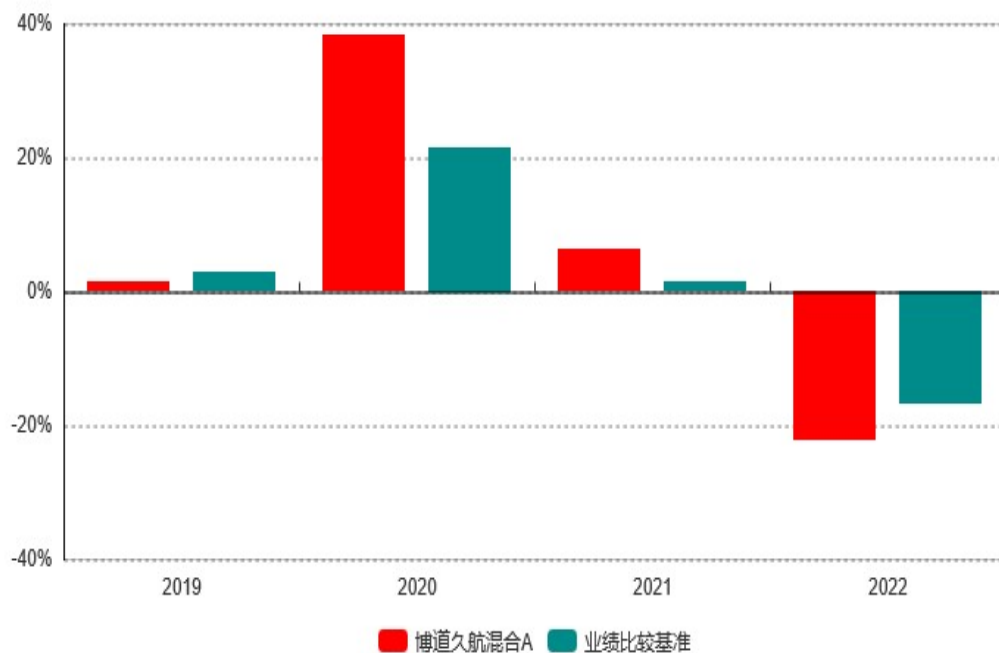
注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

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-2022年12月31日)

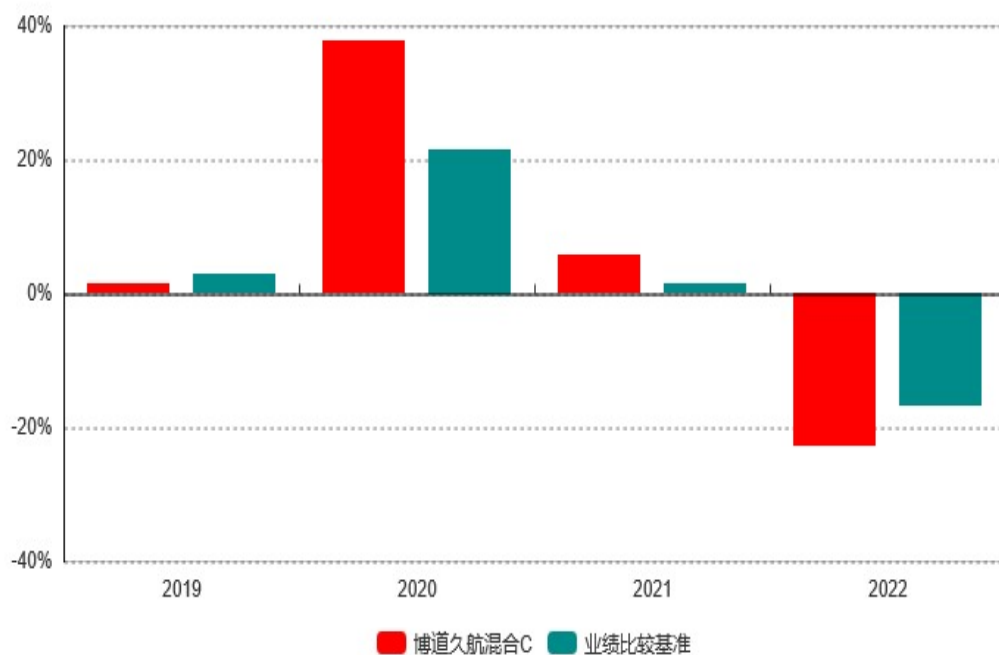


注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：图示日期为基金合同生效日至本报告期末。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。



注：图示日期为基金合同生效日至本报告期末。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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23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、博道盛彦混合型证券投资基金、博道成长智航股票型证券投资基金、博道盛兴一年持有期混合型证券投资基金、博道研究恒选混合型证券投资基金和博道和瑞多元稳健6个月持有期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、	2019-12-24	-	11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

	博道久航混合、博道消费智航、博道成长智航的基金经理、量化投资部总经理兼研究部副总经理			<p>员，2014年6月至2014年11月担任华泰资产管理有限公司量化研究员，2014年11月至2017年7月担任上海博道投资管理有限公司投资经理助理、投资经理。2017年8月加入博道基金管理有限公司，现任量化投资部总经理兼研究部副总经理。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、自2021年10月26日起担任博道成长智航</p>
--	--	--	--	--

					股票型证券投资基金基金经理至今。
--	--	--	--	--	------------------

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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下所管理的所有资产组合投资运作的公平。旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。制度中包含的主要控制方法如下：

(1) 公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

(2) 公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，建立了合理且可操作的公平交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

(3) 公司建立了清晰的投资授权制度，明确各层级投资决策主体的职责和权限划分，组合投资经理充分发挥专业判断能力，不受他人干预，在授权范围内独立行使投资决策权，维护公平的投资管理环境，维护所管理投资组合的合法利益，保证各投资组合交易决策的客观性和独立性，防范不公平及异常交易的发生。

(4) 公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上，根据不同投资组合的投资目标、

投资风格、投资范围和关联交易限制等，按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库，组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

(5) 公司交易部和监察稽核部进行日常投资交易行为监控，监察稽核部负责对各投资组合公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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14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

2022年市场波动较大，海外主线是地缘政治冲突和美联储紧缩下的滞胀主题，除美元现金、部分大宗商品和商品货币外，美元计价下多数资产呈现负回报；国内主线是地产下行和疫情干扰下，增长低于预期，债券市场表现好于股票。全年来看，煤炭板块一枝独秀，涨幅达到17.52%，电子、综合金融、计算机、传媒、建材等板块跌幅较大。

回顾2022年的市场，资金面呈现减量博弈的局面，市场交易的基调是“强反转、弱动量”。在多因子体系的分类中，从性质大类上区分，可以分为追逐“景气动量”的基本面动量类因子（景气成长类、超预期类），以及“交易衰减型”的反转类因子（大部分的量价类、价值类因子）。在过去一年的市场格局中，反转类因子全年表现出色，基本面动量类因子除二季度以外均表现羸弱，尤其是四季度进一步遭遇了较大的回撤。由于我们将更多的因子权重配置在了过往长期表现较为出色的基本面动量类因子上，因此产品业绩超额表现不尽如人意。

在此期间，我们更加紧密地进行了模型的升级迭代，一方面改进基本面动量类型的因子，除了注重“进攻性”，在因子逻辑上也加入“安全性”的考量；另一方面对于反转类因子也加大研发投入，在AI算法量价因子上进行了较为全面的改进。

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），由于配置了更多的基本面趋势因子，而因子表现全年呈现了“强反转、弱动量”的格局，产品在本报告期间跑输了业绩比较基准。

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2023年，我们将在更加均衡的因子权重配置下，通过不断提升底层大类因子有效性，致力于为投资者提供长期有竞争力的超额收益。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2022年度，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》等有关法规，本基金管理人诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，落实风险控制，强化监察稽核职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。本报告期内，本基金管理人为了确保公司业务的规范运作，主要做了以下工作：

（一）持续完善公司内部控制制度和业务流程，推动制度流程的及时更新。

公司持续以提升制度和业务流程的指导性和执行力为强化内部控制的重要抓手，以内部管理制度的全面修订和公司主要业务流程的梳理为工作重点。结合本报告期新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，贯彻落实新法规及新的监管要求。公司着重关注于公司的核心增值流程，通过对流程的研究、梳理、再造等过程实现管理上风险和回报的平衡。

（二）深化事前事中合规及风险管理，提高合规管理及风险控制有效性。

强化事前事中合规审查，严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料等，着力防范各类合规风险。在风险管理方面，夯实事前防范、事中控制和事后监督等各阶段工作，重点加强对信用风险、流动性风险等风险的管理。

（三）全面开展内部监督检查，强化公司内部控制。

公司监察稽核部坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察。通过对基金投资、销售、运营等部门的内部控制关键点进行定期和不定期检查，促进公司内部控制制度规范、执行有效，风险管理水平不断提升。

(四) 强化培训教育，持续提高全员风险合规意识。

公司积极推动各项新法规落实和风险合规教育工作。通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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，不存在任何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，未发现其存在损害基金份额持有人利益的行为，基金管理人在各重要方面的运作符合法律规定和基金合同约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

基金托管人复核了年度报告中的财务指标、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，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第24328号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	博道久航混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了博道久航混合型证券投资基金(以下简称"博道久航混合基金")的财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表，2022年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了博道久航混合基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况。</p>

形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博道久航混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>博道久航混合基金的基金管理人博道基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估博道久航混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算博道久航混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督博道久航混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运</p>

	<p>用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对博道久航混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博道久航混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	沈兆杰、朱容莹

会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
审计报告日期	2023-03-22

§7 年度财务报表

7.1 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：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	8,071,419.27	6,058,179.82
结算备付金		62,142.97	3,324.66
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	240,519,808.19	370,520,363.53
其中：股票投资		228,791,036.55	350,098,365.27
基金投资		-	-
债券投资		11,728,771.64	20,421,998.26
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-

其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		6,372.30	148,839.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	446,375.88
资产总计		248,659,742.73	377,177,083.79
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		472,892.74	354,929.85
应付管理人报酬		323,429.82	486,331.14
应付托管费		53,904.94	81,055.21
应付销售服务费		30,240.24	44,588.01
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	170,002.70	190,305.29
负债合计		1,050,470.44	1,157,209.50
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	216,858,036.62	255,571,046.46
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	30,751,235.67	120,448,827.83
净资产合计		247,609,272.29	376,019,874.29
负债和净资产总计		248,659,742.73	377,177,083.79

注：报告截止日2022年12月31日，A类基金份额净值1.1467元，C类基金份额净值1.1294元；基金份额总额216,858,036.62份，其中A类基金份额155,168,237.84份，C类基金份额61,689,798.78份。

7.2 利润表

会计主体：博道久航混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2 021年12月31日
一、营业总收入		-72,517,230.30	57,641,050.33
1.利息收入		133,113.57	840,290.70
其中：存款利息收入	7.4.7.9	133,113.35	270,762.90
债券利息收入		-	569,527.52
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		0.22	0.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-64,969,116.18	109,260,182.54
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-69,398,149.54	104,147,418.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	376,540.50	-252,284.06
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-286,101.27	-
股利收益	7.4.7.14	4,338,594.13	5,365,047.75
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-7,695,069.58	-52,825,821.63
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	13,841.89	366,398.72
减：二、营业总支出		5,897,370.60	20,937,040.09
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,535,899.23	7,590,806.91
2. 托管费	7.4.10.2.2	755,983.26	1,265,134.46
3. 销售服务费		435,257.22	720,781.10
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		10,230.71	1,248.48
其中：卖出回购金融资产支出		10,230.71	1,248.48
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		0.18	-
8. 其他费用	7.4.7.17	160,000.00	11,359,069.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-78,414,600.90	36,704,010.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-78,414,600.90	36,704,010.24
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-78,414,600.90	36,704,010.24

7.3 净资产（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：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年12月31日

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	255,571,046.46	-	120,448,827.83	376,019,874.29
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	255,571,046.46	-	120,448,827.83	376,019,874.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-38,713,009.84	-	-89,697,592.16	-128,410,602.00
（一）、综合收益总额	-	-	-78,414,600.90	-78,414,600.90
（二）、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）	-38,713,009.84	-	-11,282,991.26	-49,996,001.10
其中：1.基金申购款	25,295,046.80	-	6,967,468.86	32,262,515.66
2.基金赎回款	-64,008,056.64	-	-18,250,460.12	-82,258,516.76
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综	-	-	-	-

合收益结转留存收益				
四、本期期末净资产（基金净值）	216,858,036.62	-	30,751,235.67	247,609,272.29
项目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	530,955,368.79	-	205,504,054.95	736,459,423.74
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	530,955,368.79	-	205,504,054.95	736,459,423.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-275,384,322.33	-	-85,055,227.12	-360,439,549.45
（一）、综合收益总额	-	-	36,704,010.24	36,704,010.24
（二）、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）	-275,384,322.33	-	-121,759,237.36	-397,143,559.69
其中：1.基金申购款	78,650,104.01	-	34,733,738.50	113,383,842.51
2.基金赎回款	-354,034,426.34	-	-156,492,975.86	-510,527,402.20

（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	255,571,046.46	-	120,448,827.83	376,019,874.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 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》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%。

本财务报表由本基金的基金管理人博道基金管理有限公司于2023年3月22日批准报出。

7.4.2 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7.4.4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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年度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2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则：

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

(1) 金融资产

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

债务工具：

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具：

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)：

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则：

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)：

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

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

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

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳

的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于

证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号--金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号--金融资产转移》、《企业会计准则第24号一套期会计》及《企业会计准则第37号--金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年颁布了《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》(财会[2022]14号)，中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表时，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于2022年1月1日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、应收利息和应收申购款，金额分别为6,058,179.82元、3,324.66元、446,375.88元和148,839.90元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为6,062,353.99元、3,325.87元、0.00元和148,839.90元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为370,520,363.53元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为370,962,564.03元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为354,929.85元、486,331.14元、81,055.21元、44,588.01元和305.29元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为354,929.85元、486,331.14元、81,055.21元、44,588.01元和305.29元。

于2021年12月31日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	2,548,779.57	2,331,998.59
等于：本金	2,547,626.14	2,331,998.59
加：应计利息	1,153.43	-

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	5,522,639.70	3,726,181.23
等于：本金	5,521,272.06	3,726,181.23
加：应计利息	1,367.64	-
合计	8,071,419.27	6,058,179.82

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	232,283,159.93	-	228,791,036.55	-3,492,123.38	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	11,507,750.00	229,321.64	11,728,771.64	-8,300.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	11,507,750.00	229,321.64	11,728,771.64	-8,300.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	243,790,909.93	229,321.64	240,519,808.19	-3,500,423.38	

项目	上年度末 2021年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	345,835,719.07	-	350,098,365.27	4,262,646.20
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	20,489,998.26	20,421,998.26	-68,000.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	20,489,998.26	20,421,998.26	-68,000.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	366,325,717.33	-	370,520,363.53	4,194,646.20

注：如果本报告期末或上年度末本基金持有中国存托凭证，则股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	446,375.88
其他应收款	-	-

待摊费用	-	-
合计	-	446,375.88

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2.70	305.29
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	40,000.00	60,000.00
预提费用-信息披露费	130,000.00	130,000.00
合计	170,002.70	190,305.29

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 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 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	184,412,453.17	184,412,453.17
本期申购	4,690,142.40	4,690,142.40
本期赎回（以“-”号填列）	-33,934,357.73	-33,934,357.73
本期末	155,168,237.84	155,168,237.84

7.4.7.7.2 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 2022年01月01日至2022年12月31日
-----------------	-------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	71,158,593.29	71,158,593.29
本期申购	20,604,904.40	20,604,904.40
本期赎回（以“-”号填列）	-30,073,698.91	-30,073,698.91
本期末	61,689,798.78	61,689,798.78

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。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 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
本期期初	110,571,872.38	-22,893,178.21	87,678,694.17
本期利润	-50,524,025.71	-6,073,539.90	-56,597,565.61
本期基金份额交易产生的变动数	-13,187,454.51	4,872,143.99	-8,315,310.52
其中：基金申购款	2,071,032.96	-783,810.49	1,287,222.47
基金赎回款	-15,258,487.47	5,655,954.48	-9,602,532.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,860,392.16	-24,094,574.12	22,765,818.04

7.4.7.8.2 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
本期期初	41,546,291.07	-8,776,157.41	32,770,133.66
本期利润	-20,195,505.61	-1,621,529.68	-21,817,035.29
本期基金份额交易产生的变动数	-3,854,797.45	887,116.71	-2,967,680.74
其中：基金申购款	8,798,010.55	-3,117,764.16	5,680,246.39

基金赎回款	-12,652,808.00	4,004,880.87	-8,647,927.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,495,988.01	-9,510,570.38	7,985,417.63

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
活期存款利息收入	37,608.99	72,998.05
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	90,585.99	197,724.72
结算备付金利息收入	4,918.37	40.13
其他	-	-
合计	133,113.35	270,762.90

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
卖出股票成交总额	3,296,091,796.85	4,750,735,706.57
减：卖出股票成本总额	3,357,572,342.06	4,646,588,287.72
减：交易费用	7,917,604.33	-
买卖股票差价收入	-69,398,149.54	104,147,418.85

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
----	-----------------------------------	--

债券投资收益——利息收入	289,176.55	-
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	87,363.95	-252,284.06
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	376,540.50	-252,284.06

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	24,131,877.67	68,459,450.68
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	23,501,842.37	67,253,084.06
减：应计利息总额	542,649.23	1,458,650.68
减：交易费用	22.12	-
买卖债券差价收入	87,363.95	-252,284.06

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无权证投资收益。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间收益金额 2021年01月01日至2021年 12月31日
期货投资收益	-286,101.27	-

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
股票投资产生的股利收益	4,338,594.13	5,365,047.75
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,338,594.13	5,365,047.75

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
1.交易性金融资产	-7,695,069.58	-52,825,821.63
——股票投资	-7,754,769.58	-52,974,788.89
——债券投资	59,700.00	148,967.26
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-

合计	-7,695,069.58	-52,825,821.63
----	---------------	----------------

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
基金赎回费收入	13,796.52	364,748.90
转换费收入	45.37	1,649.82
合计	13,841.89	366,398.72

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中A类份额将不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类份额将赎回费收入全额归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中，A类份额将不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产，C类份额将转出基金的赎回费全额归入转出基金的基金资产。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
审计费用	40,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
交易费用	-	11,179,069.14
合计	160,000.00	11,359,069.14

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
上海博道投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海博道如思投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
上海博道如见投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
上海博道如舍投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
上海博道如知投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
莫泰山	基金管理人的股东

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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	6,514,030,881.66	100.00%	9,088,931,391.41	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期	成交金额	占当期

		债券成交总额的比例		债券成交总额的比例
兴业证券	20,608,364.52	100.00%	54,132,616.80	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
兴业证券	76,003,000.00	100.00%	19,002,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31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	4,242,239.51	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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	6,362,357.09	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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,535,899.23	7,590,806.91
其中：支付销售机构的客户维护费	1,668,438.59	2,855,429.14

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	755,983.26	1,265,134.46

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。

7.4.10.2.3 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 2022年01月01日至2022年12月31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	-	7,943.59	7,943.59

公司			
兴业证券	-	197,475.92	197,475.92
合计	-	205,419.51	205,419.51
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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	-	9,000.94	9,000.94
兴业证券	-	401,438.93	401,438.93
合计	-	410,439.87	410,439.87

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×0.50%÷当年天数。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年12月31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	-	-
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	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	1.29%	1.08%

博道久航混合C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至 2022年12月31日	2021年01月01日至 2021年12月31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	-	-
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	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	1.62%	1.41%

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。

7.4.10.4.2 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

基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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	
	2022年01月01日至2022年12月31日		2021年01月01日至2021年12月31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	5,522,639.70	90,585.99	3,726,181.23	197,724.72

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。

7.4.10.6 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 2022年01月01日至2022年12月31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	600030	中信证券	配股	24,915	359,523.45
兴业证券	301110	青木股份	网下发行	1,830	115,473.00
兴业证券	688448	磁谷科技	网下发行	1,985	65,306.50
兴业证券	301165	锐捷网络	网下发行	2,843	92,056.34
上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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	300941	创识科技	网下发行	3,989	85,005.59
兴业证券	688195	腾景科技	网下发行	2,693	36,624.80
兴业证券	688639	华恒生物	网下发行	2,302	53,314.32
兴业证券	300979	华利集团	网下发行	7,443	247,256.46
兴业证券	688597	煜邦电力	网下发行	3,907	22,973.16
兴业证券	688778	厦钨新能	网下发行	5,075	124,337.50
兴业证券	301136	招标股份	网下发行	7,172	75,449.44

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688031	星环科技	2022-10-11	6个月以上	科创板打新限售	47.34	78.80	5,787	273,956.58	456,015.60	-
688205	德科立	2022-08-02	6个月以上	科创板打新限售	48.51	48.98	3,389	164,400.39	165,993.22	-
688293	奥浦迈	2022-08-26	6个月以上	科创板打新限售	80.20	99.12	1,287	103,217.40	127,567.44	-
688114	华大智造	2022-09-02	6个月以上	科创板打新限售	87.18	105.05	1,190	103,744.20	125,009.50	-
688152	麒麟信安	2022-10-18	6个月以上	科创板打新限售	68.89	130.72	833	57,385.37	108,889.76	-
688381	帝奥微	2022-08-15	6个月以上	科创板打新限售	41.68	37.98	2,518	104,950.24	95,633.64	-
688496	清越科技	2022-12-21	6个月以上	科创板打新限售	9.16	8.65	10,160	93,065.60	87,884.00	-
688419	耐科	2022-10-31	6个	科创	37.85	29.44	2,952	111,733.20	86,906.88	-

	装备		月以上	板打新限售						
688184	帕瓦股份	2022-09-09	6个月以上	科创板打新限售	51.88	33.82	2,340	121,399.20	79,138.80	-
688244	永信至诚	2022-10-12	6个月以上	科创板打新限售	49.19	50.14	1,506	74,080.14	75,510.84	-
688416	恒烁股份	2022-08-22	6个月以上	科创板打新限售	65.11	37.01	1,453	94,604.83	53,775.53	-
301269	华大九天	2022-07-21	6个月以上	创业板打新限售	32.69	87.94	311	10,166.59	27,349.34	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	6个月以上	创业板打新限售	33.65	69.68	374	12,585.10	26,060.32	-
301095	广立微	2022-07-28	6个月以上	创业板打新限售	58.00	86.49	270	15,660.00	23,352.30	-
301175	中科环保	2022-06-30	6个月以上	创业板打新限售	3.82	6.01	3,514	13,423.48	21,119.14	-
301327	华宝新能	2022-09-08	6个月以上	创业板打新限售	237.50	176.97	109	25,887.50	19,289.73	-

				售						
3013 67	怡和 嘉业	2022- 10-21	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	119.8 8	175.7 8	89	10,66 9.32	15,64 4.42	-
3013 01	川宁 生物	2022- 12-20	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	5.00	7.53	2,024	10,12 0.00	15,24 0.72	-
3011 95	北路 智控	2022- 07-25	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	71.17	73.04	200	14,23 4.00	14,60 8.00	-
3012 67	华夏 眼科	2022- 10-26	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	50.88	66.20	208	10,58 3.04	13,76 9.60	-
3013 30	熵基 科技	2022- 08-10	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	43.32	31.31	436	18,88 7.52	13,65 1.16	-
3012 97	富乐 德	2022- 12-23	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	8.48	12.99	1,015	8,60 7.20	13,18 4.85	-
3012 30	泓博 医药	2022- 10-21	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	40.00	48.32	269	10,76 0.00	12,99 8.08	-
3013 63	美好 医疗	2022- 09-28	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	30.66	37.85	328	10,05 6.48	12,41 4.80	-
3013	凯格	2022-	6个	创业	46.33	48.99	249	11,53	12,19	-

38	精机	08-08	月以上	板打 新限售				6.17	8.51	
3013 11	昆船 智能	2022- 11-23	6个 月以上	创业 板打 新限售	13.88	15.86	736	10,21 5.68	11,67 2.96	-
3011 52	天力 锂能	2022- 08-19	6个 月以上	创业 板打 新限售	57.00	46.64	246	14,02 2.00	11,47 3.44	-
3013 79	天山 电子	2022- 10-19	6个 月以上	创业 板打 新限售	31.51	24.63	427	13,45 4.77	10,51 7.01	-
3012 73	瑞晨 环保	2022- 10-11	6个 月以上	创业 板打 新限售	37.89	37.79	277	10,49 5.53	10,46 7.83	-
3011 32	满坤 科技	2022- 08-03	6个 月以上	创业 板打 新限售	26.80	24.48	417	11,17 5.60	10,20 8.16	-
3013 06	西测 测试	2022- 07-19	6个 月以上	创业 板打 新限售	43.23	42.29	240	10,37 5.20	10,14 9.60	-
3012 96	新巨 丰	2022- 08-26	6个 月以上	创业 板打 新限售	18.19	14.90	677	12,31 4.63	10,08 7.30	-
3013 91	卡莱 特	2022- 11-24	6个 月以上	创业 板打 新限售	96.00	80.97	124	11,90 4.00	10,04 0.28	-

				售						
3013 89	隆扬 电子	2022- 10-18	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	22.50	17.16	584	13,14 0.00	10,02 1.44	-
3011 39	元道 通信	2022- 06-30	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	38.46	25.31	390	14,99 9.40	9,87 0.90	-
3013 28	维峰 电子	2022- 08-30	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	78.80	76.96	125	9,85 0.00	9,62 0.00	-
3013 39	通行 宝	2022- 09-02	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	18.78	15.59	617	11,58 7.26	9,61 9.03	-
3011 71	易点 天下	2022- 08-10	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	18.18	17.72	539	9,79 9.02	9,55 1.08	-
3012 23	中荣 股份	2022- 10-13	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	26.28	18.13	515	13,53 4.20	9,33 6.95	-
3012 77	新天 地	2022- 11-09	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	27.00	25.78	355	9,58 5.00	9,15 1.90	-
3011 65	锐捷 网络	2022- 11-14	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	32.38	31.61	285	9,22 8.30	9,00 8.85	-
3012	珠城	2022-	6个	创业	67.40	44.80	195	13,14	8,73	-

80	科技	12-19	月以上	板打新限售				3.00	6.00	
301377	鼎泰高科	2022-11-11	6个月以上	创业板打新限售	22.88	17.63	486	11,119.68	8,568.18	-
301335	天元宠物	2022-11-11	6个月以上	创业板打新限售	49.98	33.82	252	12,594.96	8,522.64	-
301290	东星医疗	2022-11-23	6个月以上	创业板打新限售	44.09	35.13	242	10,669.78	8,501.46	-
301227	森鹰窗业	2022-09-16	6个月以上	创业板打新限售	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301326	捷邦科技	2022-09-09	6个月以上	创业板打新限售	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74	-
301365	矩阵股份	2022-11-14	6个月以上	创业板打新限售	34.72	23.87	341	11,839.52	8,139.67	-
301282	金禄电子	2022-08-18	6个月以上	创业板打新限售	30.38	25.25	310	9,417.80	7,827.50	-
301366	一博科技	2022-09-19	6个月以上	创业板打新限售	65.35	45.09	171	11,174.85	7,710.39	-

				售						
301176	逸豪新材	2022-09-21	6个月以上	创业板打新限售	23.88	16.89	456	10,889.28	7,701.84	-
301197	工大科雅	2022-07-29	6个月以上	创业板打新限售	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-
301161	唯万密封	2022-09-06	6个月以上	创业板打新限售	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301398	星源卓镁	2022-12-08	6个月以上	创业板打新限售	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-
301313	凡拓数创	2022-09-22	6个月以上	创业板打新限售	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301285	鸿日达	2022-09-21	6个月以上	创业板打新限售	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301359	东南电子	2022-11-02	6个月以上	创业板打新限售	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-
301349	信德新材	2022-08-30	6个月以上	创业板打新限售	138.88	103.52	63	8,749.44	6,521.76	-
3013	维海	2022-	6个	创业	64.68	41.74	155	10,02	6,46	-

18	德	08-03	月以上	板打新限售				5.40	9.70	
301265	华新环保	2022-12-08	6个月以上	创业板打新限售	13.28	11.40	560	7,436.80	6,384.00	-
301388	欣灵电气	2022-10-26	6个月以上	创业板打新限售	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301368	丰立智能	2022-12-07	6个月以上	创业板打新限售	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301300	远翔新材	2022-08-09	6个月以上	创业板打新限售	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-
301270	汉仪股份	2022-08-19	6个月以上	创业板打新限售	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301319	唯特偶	2022-09-22	6个月以上	创业板打新限售	47.75	53.27	111	5,300.25	5,912.97	-
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6个月以上	创业板打新限售	40.66	22.61	258	10,490.28	5,833.38	-
301231	荣信文化	2022-08-31	6个月以上	创业板打新限售	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-

				售						
301233	盛帮股份	2022-06-24	6个月以上	创业板打新限售	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301316	慧博云通	2022-09-29	6个月以上	创业板打新限售	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301309	万得凯	2022-09-08	6个月以上	创业板打新限售	39.00	24.46	173	6,747.00	4,231.58	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人兴业证券开立于兴业银行股份有限公司的托管账户，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2022年12月31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(2021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0.11%)。

7.4.13.3 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2022年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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7.4.12。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2022年12月31日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.83%。

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2022年12月31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246,118,312.08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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	8,071,419.27	-	-	-	-	-	8,071,419.27
结算备付金	62,142.97	-	-	-	-	-	62,142.97
交易性金融资产	11,222,305.48	-	506,466.16	-	-	228,791,036.55	240,519,808.19
应收申购款	-	-	-	-	-	6,372.30	6,372.30
资产总计	19,355,867.72	-	506,466.16	-	-	228,797,408.85	248,659,742.73
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	472,892.74	472,892.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	323,429.82	323,429.82
应付托管费	-	-	-	-	-	53,904.94	53,904.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-	30,240.24	30,240.24
其他负	-	-	-	-	-	170,002.70	170,002.70

债							
负债总计	-	-	-	-	-	1,050,470.44	1,050,470.44
利率敏感度缺口	19,355,867.72	-	506,466.16	-	-	227,746,938.41	247,609,272.29
上年度末 2021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	6,058,179.82	-	-	-	-	-	6,058,179.82
结算备付金	3,324.66	-	-	-	-	-	3,324.66
交易性金融资产	-	20,024,000.00	-	-	397,998.26	350,098,365.27	370,520,363.53
应收利息	-	-	-	-	-	446,375.88	446,375.88
应收申购款	-	-	-	-	-	148,839.90	148,839.90
资产总计	6,061,504.48	20,024,000.00	-	-	397,998.26	350,693,581.05	377,177,083.79
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	354,929.85	354,929.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	486,331.14	486,331.14
应付托管费	-	-	-	-	-	81,055.21	81,055.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-	44,588.01	44,588.01
其他负债	-	-	-	-	-	190,305.29	190,305.29
负债总计	-	-	-	-	-	1,157,209.50	1,157,209.50
利率敏感度缺口	6,061,504.48	20,024,000.00	-	-	397,998.26	349,536,371.55	376,019,874.29

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为4.74%(2021年12月31日：5.43%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2021年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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和国债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5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021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	228,791,036.55	92.40	350,098,365.27	93.11
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	228,791,036.55	92.40	350,098,365.27	93.11

7.4.13.4.3.2 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	1.中证800指数收益率上升5%	11,221,571.87	18,914,140.37
	2.中证800指数收益率下降5%	-11,221,571.87	-18,914,140.37

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	226,725,044.22	342,379,914.98
第二层次	11,728,771.64	24,235,543.29
第三层次	2,065,992.33	3,904,905.26
合计	240,519,808.19	370,520,363.53

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	3,904,905.26	3,904,905.26
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	6,267,728.27	6,267,728.27
转出第三层次	-	8,364,170.46	8,364,170.46
当期利得或损失总额	-	257,529.26	257,529.26

其中：计入损益的利得或损失	-	257,529.26	257,529.26
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,065,992.33	2,065,992.33
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	141,756.15	141,756.15
项目	上年度可比同期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,979,585.78	2,979,585.78
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	925,319.48	925,319.48
其中：计入损益的利得或损失	-	925,319.48	925,319.48
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	3,904,905.26	3,904,905.26
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	925,319.48	925,319.48

注：1.于2022年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2022年度，本基金从第三层次转出的交易性金融

资产均为限售期结束可正常交易的股票投资；

2. 计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期内股票投资	2,065,992.33	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.91%-24 7.56%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期内股票投资	3,904,905.26	平均价格亚式期权模型	预期波动率	17.17%-22 4.71%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021年12月31日：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	228,791,036.55	92.01
	其中：股票	228,791,036.55	92.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,728,771.64	4.72
	其中：债券	11,728,771.64	4.72
	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	8,133,562.24	3.27
8	其他各项资产	6,372.30	0.00
9	合计	248,659,742.73	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。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,712,352.00	2.31
B	采矿业	7,906,981.60	3.19
C	制造业	146,421,634.66	59.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,689,843.81	3.11
E	建筑业	4,317,012.00	1.74
F	批发和零售业	2,776,206.00	1.12
G	交通运输、仓储和邮政业	4,644,376.90	1.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,524,546.41	4.25
J	金融业	36,665,930.65	14.81

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	216,030.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	1,849,568.96	0.75
N	水利、环境和公共设施管理业	21,119.14	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	39,829.92	0.02
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	228,791,036.55	92.40

8.2.2 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。

8.3 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	600519	贵州茅台	9,205	15,897,035.00	6.42
2	601318	中国平安	133,697	6,283,759.00	2.54
3	300502	新易盛	262,700	6,239,125.00	2.52
4	000651	格力电器	174,700	5,646,304.00	2.28
5	600036	招商银行	124,277	4,630,561.02	1.87
6	002304	洋河股份	25,000	4,012,500.00	1.62
7	002594	比亚迪	13,900	3,571,883.00	1.44
8	000895	双汇发展	132,200	3,427,946.00	1.38
9	300628	亿联网络	56,100	3,399,099.00	1.37
10	000921	海信家电	255,400	3,363,618.00	1.36
11	300750	宁德时代	8,100	3,186,702.00	1.29
12	600150	中国船舶	141,500	3,152,620.00	1.27
13	600157	永泰能源	2,019,900	3,090,447.00	1.25

14	002299	圣农发展	123,300	2,920,977.00	1.18
15	600481	双良节能	216,900	2,806,686.00	1.13
16	600732	爱旭股份	74,200	2,806,244.00	1.13
17	300761	立华股份	81,500	2,791,375.00	1.13
18	601838	成都银行	178,000	2,723,400.00	1.10
19	688556	高测股份	35,967	2,698,244.34	1.09
20	603609	禾丰股份	222,846	2,638,496.64	1.07
21	601668	中国建筑	478,400	2,597,712.00	1.05
22	601012	隆基绿能	60,580	2,560,110.80	1.03
23	601166	兴业银行	141,273	2,484,992.07	1.00
24	601699	潞安环能	142,156	2,395,328.60	0.97
25	600795	国电电力	527,800	2,253,706.00	0.91
26	600809	山西汾酒	7,900	2,251,421.00	0.91
27	600037	歌华有线	259,800	2,114,772.00	0.85
28	300494	盛天网络	141,300	2,109,609.00	0.85
29	002422	科伦药业	75,900	2,019,699.00	0.82
30	002050	三花智控	94,100	1,996,802.00	0.81
31	002938	鹏鼎控股	69,400	1,904,336.00	0.77
32	002273	水晶光电	160,400	1,891,116.00	0.76
33	300777	中简科技	38,400	1,887,360.00	0.76
34	300274	阳光电源	16,800	1,878,240.00	0.76
35	002831	裕同科技	56,200	1,858,534.00	0.75
36	600060	海信视像	134,300	1,818,422.00	0.73
37	600160	巨化股份	116,800	1,811,568.00	0.73
38	688677	海泰新光	15,962	1,803,706.00	0.73
39	603613	国联股份	20,200	1,786,488.00	0.72
40	600438	通威股份	46,000	1,774,680.00	0.72
41	603056	德邦股份	85,100	1,772,633.00	0.72
42	002463	沪电股份	148,800	1,770,720.00	0.72
43	600901	江苏金租	320,300	1,755,244.00	0.71
44	000408	藏格矿业	67,200	1,745,184.00	0.70

45	000878	云南铜业	147,800	1,736,650.00	0.70
46	601231	环旭电子	106,437	1,727,472.51	0.70
47	600133	东湖高新	312,600	1,719,300.00	0.69
48	601988	中国银行	543,200	1,716,512.00	0.69
49	300073	当升科技	30,400	1,714,560.00	0.69
50	300017	网宿科技	307,000	1,713,060.00	0.69
51	600089	特变电工	84,200	1,690,736.00	0.68
52	002129	TCL中环	44,653	1,681,631.98	0.68
53	000596	古井贡酒	6,300	1,681,470.00	0.68
54	300910	瑞丰新材	13,600	1,677,016.00	0.68
55	000997	新大陆	127,800	1,662,678.00	0.67
56	000915	华特达因	35,000	1,592,500.00	0.64
57	688819	天能股份	43,224	1,588,049.76	0.64
58	688063	派能科技	5,000	1,578,250.00	0.64
59	000567	海德股份	113,185	1,575,535.20	0.64
60	603259	药明康德	19,018	1,540,458.00	0.62
61	603612	索通发展	59,100	1,537,782.00	0.62
62	002966	苏州银行	197,600	1,537,328.00	0.62
63	002807	江阴银行	380,201	1,509,397.97	0.61
64	002142	宁波银行	44,978	1,459,536.10	0.59
65	601877	正泰电器	50,800	1,407,160.00	0.57
66	603659	璞泰来	26,800	1,390,652.00	0.56
67	000725	京东方 A	409,100	1,382,758.00	0.56
68	600008	首创环保	483,907	1,369,456.81	0.55
69	603185	上机数控	12,800	1,354,880.00	0.55
70	000568	泸州老窖	5,900	1,323,252.00	0.53
71	000858	五粮液	6,903	1,247,303.07	0.50
72	601567	三星医疗	92,000	1,240,160.00	0.50
73	605117	德业股份	3,700	1,225,440.00	0.49
74	601908	京运通	184,600	1,212,822.00	0.49
75	002371	北方华创	5,000	1,126,500.00	0.45

76	600918	中泰证券	175,100	1,122,391.00	0.45
77	000338	潍柴动力	109,800	1,117,764.00	0.45
78	601919	中远海控	105,610	1,086,726.90	0.44
79	300316	晶盛机电	17,000	1,080,520.00	0.44
80	600660	福耀玻璃	30,600	1,073,142.00	0.43
81	600028	中国石化	246,000	1,072,560.00	0.43
82	000538	云南白药	19,680	1,069,804.80	0.43
83	600030	中信证券	53,315	1,061,501.65	0.43
84	601375	中原证券	291,500	1,061,060.00	0.43
85	601088	中国神华	38,200	1,055,084.00	0.43
86	002460	赣锋锂业	15,000	1,042,650.00	0.42
87	603876	鼎胜新材	25,300	1,038,312.00	0.42
88	601857	中国石油	208,800	1,037,736.00	0.42
89	002812	恩捷股份	7,900	1,037,191.00	0.42
90	002945	华林证券	77,800	1,025,404.00	0.41
91	600995	南网储能	67,700	976,234.00	0.39
92	600256	广汇能源	108,100	975,062.00	0.39
93	600741	华域汽车	55,200	956,616.00	0.39
94	600998	九州通	72,900	950,616.00	0.38
95	000028	国药一致	28,600	940,654.00	0.38
96	600233	圆通速递	46,700	938,203.00	0.38
97	688082	盛美上海	11,532	921,406.80	0.37
98	600362	江西铜业	52,800	920,304.00	0.37
99	002318	久立特材	55,000	915,200.00	0.37
100	002139	拓邦股份	87,500	907,375.00	0.37
101	601689	拓普集团	15,300	896,274.00	0.36
102	601288	农业银行	307,900	895,989.00	0.36
103	600219	南山铝业	271,800	888,786.00	0.36
104	000950	重药控股	174,200	884,936.00	0.36
105	600548	深高速	94,300	846,814.00	0.34
106	600583	海油工程	139,400	844,764.00	0.34

107	600888	新疆众和	101,000	827,190.00	0.33
108	600600	青岛啤酒	7,600	817,000.00	0.33
109	002484	江海股份	35,200	787,424.00	0.32
110	601601	中国太保	31,500	772,380.00	0.31
111	000932	华菱钢铁	159,100	747,770.00	0.30
112	603301	振德医疗	19,200	730,560.00	0.30
113	688276	百克生物	9,800	677,278.00	0.27
114	300298	三诺生物	19,800	667,854.00	0.27
115	300059	东方财富	32,800	636,320.00	0.26
116	002020	京新药业	52,200	635,796.00	0.26
117	601998	中信银行	125,700	625,986.00	0.25
118	688617	惠泰医疗	2,000	613,860.00	0.25
119	601995	中金公司	16,003	610,194.39	0.25
120	601066	中信建投	25,631	608,736.25	0.25
121	002939	长城证券	70,500	583,740.00	0.24
122	601666	平煤股份	48,700	526,447.00	0.21
123	601628	中国人寿	13,700	508,544.00	0.21
124	601162	天风证券	172,100	493,927.00	0.20
125	600155	华创阳安	73,600	478,400.00	0.19
126	688031	星环科技	5,787	456,015.60	0.18
127	002078	太阳纸业	34,900	402,048.00	0.16
128	688078	龙软科技	11,800	377,246.00	0.15
129	002258	利尔化学	20,500	368,180.00	0.15
130	002179	中航光电	4,100	236,816.00	0.10
131	601888	中国中免	1,000	216,030.00	0.09
132	601336	新华保险	6,400	192,512.00	0.08
133	301301	川宁生物	20,238	178,256.02	0.07
134	688205	德科立	3,389	165,993.22	0.07
135	601319	中国人保	30,600	159,732.00	0.06
136	600705	中航产融	46,600	152,848.00	0.06
137	301297	富乐德	10,147	150,256.17	0.06

138	688141	杰华特	3,133	148,817.50	0.06
139	688293	奥浦迈	1,287	127,567.44	0.05
140	688114	华大智造	1,190	125,009.50	0.05
141	301112	信邦智能	3,984	123,862.56	0.05
142	002324	普利特	7,600	121,600.00	0.05
143	688152	麒麟信安	833	108,889.76	0.04
144	688381	帝奥微	2,518	95,633.64	0.04
145	301280	珠城科技	1,948	92,441.75	0.04
146	688498	源杰科技	773	92,396.69	0.04
147	688147	微导纳米	3,650	91,542.00	0.04
148	688496	清越科技	10,160	87,884.00	0.04
149	688419	耐科装备	2,952	86,906.88	0.04
150	688184	帕瓦股份	2,340	79,138.80	0.03
151	688244	永信至诚	1,506	75,510.84	0.03
152	688410	山外山	2,952	74,597.04	0.03
153	688525	佰维存储	4,614	74,100.84	0.03
154	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.03
155	688416	恒烁股份	1,453	53,775.53	0.02
156	301269	华大九天	311	27,349.34	0.01
157	301239	普瑞眼科	374	26,060.32	0.01
158	301095	广立微	270	23,352.30	0.01
159	301175	中科环保	3,514	21,119.14	0.01
160	301327	华宝新能	109	19,289.73	0.01
161	301367	怡和嘉业	89	15,644.42	0.01
162	301195	北路智控	200	14,608.00	0.01
163	301267	华夏眼科	208	13,769.60	0.01
164	301330	熵基科技	436	13,651.16	0.01
165	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.01
166	301363	美好医疗	328	12,414.80	0.01
167	301338	凯格精机	249	12,198.51	0.00
168	301311	昆船智能	736	11,672.96	0.00

169	301152	天力锂能	246	11,473.44	0.00
170	301379	天山电子	427	10,517.01	0.00
171	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
172	301132	满坤科技	417	10,208.16	0.00
173	301306	西测测试	240	10,149.60	0.00
174	301296	新巨丰	677	10,087.30	0.00
175	301391	卡莱特	124	10,040.28	0.00
176	301389	隆扬电子	584	10,021.44	0.00
177	301139	元道通信	390	9,870.90	0.00
178	301328	维峰电子	125	9,620.00	0.00
179	301339	通行宝	617	9,619.03	0.00
180	301171	易点天下	539	9,551.08	0.00
181	301223	中荣股份	515	9,336.95	0.00
182	301277	新天地	355	9,151.90	0.00
183	301165	锐捷网络	285	9,008.85	0.00
184	301377	鼎泰高科	486	8,568.18	0.00
185	301335	天元宠物	252	8,522.64	0.00
186	301290	东星医疗	242	8,501.46	0.00
187	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
188	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
189	301365	矩阵股份	341	8,139.67	0.00
190	301282	金禄电子	310	7,827.50	0.00
191	301366	一博科技	171	7,710.39	0.00
192	301176	逸豪新材	456	7,701.84	0.00
193	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
194	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
195	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
196	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
197	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
198	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
199	301349	信德新材	63	6,521.76	0.00

200	301318	维海德	155	6,469.70	0.00
201	301265	华新环保	560	6,384.00	0.00
202	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
203	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
204	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
205	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
206	301319	唯特偶	111	5,912.97	0.00
207	301276	嘉曼服饰	258	5,833.38	0.00
208	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
209	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
210	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
211	301309	万得凯	173	4,231.58	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300750	宁德时代	32,220,950.00	8.57
2	600519	贵州茅台	30,580,990.00	8.13
3	601318	中国平安	26,248,090.00	6.98
4	002594	比亚迪	26,076,232.99	6.93
5	603868	飞科电器	25,204,949.00	6.70
6	601088	中国神华	21,882,592.00	5.82
7	600188	兖矿能源	20,628,344.28	5.49
8	600036	招商银行	19,840,566.97	5.28
9	002705	新宝股份	19,185,846.00	5.10
10	000651	格力电器	19,128,181.00	5.09
11	000568	泸州老窖	18,831,096.85	5.01
12	600438	通威股份	18,014,189.00	4.79
13	603259	药明康德	17,324,544.51	4.61

14	002129	TCL中环	16,651,016.32	4.43
15	600089	特变电工	16,308,027.00	4.34
16	002304	洋河股份	15,641,390.00	4.16
17	002460	赣锋锂业	15,039,009.61	4.00
18	601012	隆基绿能	14,994,338.14	3.99
19	600256	广汇能源	14,956,378.34	3.98
20	600863	内蒙华电	14,616,390.00	3.89
21	600690	海尔智家	14,459,014.00	3.85
22	601166	兴业银行	14,242,481.08	3.79
23	600499	科达制造	13,795,538.00	3.67
24	000567	海德股份	13,745,363.80	3.66
25	601838	成都银行	13,442,439.39	3.57
26	002497	雅化集团	13,261,454.00	3.53
27	603799	华友钴业	13,152,220.80	3.50
28	600905	三峡能源	13,086,043.00	3.48
29	600809	山西汾酒	12,658,019.00	3.37
30	002240	盛新锂能	12,527,066.00	3.33
31	000792	盐湖股份	12,428,953.00	3.31
32	300769	德方纳米	12,393,298.02	3.30
33	300628	亿联网络	12,391,805.83	3.30
34	002466	天齐锂业	12,241,497.00	3.26
35	688556	高测股份	12,191,136.23	3.24
36	600160	巨化股份	12,117,261.64	3.22
37	600887	伊利股份	11,919,437.00	3.17
38	000921	海信家电	11,656,273.00	3.10
39	601699	潞安环能	11,618,687.29	3.09
40	300073	当升科技	11,610,911.88	3.09
41	601238	广汽集团	11,349,120.69	3.02
42	002050	三花智控	11,347,429.00	3.02
43	002371	北方华创	11,311,393.00	3.01
44	300316	晶盛机电	11,132,808.93	2.96

45	600157	永泰能源	11,094,594.00	2.95
46	600481	双良节能	11,071,153.00	2.94
47	603659	璞泰来	10,941,063.25	2.91
48	603392	万泰生物	10,818,463.60	2.88
49	603613	国联股份	10,652,984.02	2.83
50	300861	美畅股份	10,490,647.00	2.79
51	601328	交通银行	10,485,382.80	2.79
52	300390	天华超净	10,143,229.00	2.70
53	000553	安道麦A	10,126,398.84	2.69
54	688063	派能科技	10,122,178.94	2.69
55	300502	新易盛	10,116,133.00	2.69
56	603876	鼎胜新材	9,896,249.00	2.63
57	002179	中航光电	9,867,293.60	2.62
58	603185	上机数控	9,856,163.00	2.62
59	601898	中煤能源	9,780,140.00	2.60
60	603529	爱玛科技	9,632,139.40	2.56
61	000895	双汇发展	9,630,668.50	2.56
62	603127	昭衍新药	9,588,347.87	2.55
63	601919	中远海控	9,558,520.70	2.54
64	600233	圆通速递	9,555,182.00	2.54
65	601857	中国石油	9,447,776.00	2.51
66	000858	五粮液	9,111,368.00	2.42
67	300775	三角防务	9,032,548.00	2.40
68	603609	禾丰股份	9,031,113.75	2.40
69	600732	爱旭股份	8,987,515.98	2.39
70	002459	晶澳科技	8,959,066.00	2.38
71	603345	安井食品	8,886,765.37	2.36
72	601668	中国建筑	8,776,633.34	2.33
73	600600	青岛啤酒	8,701,705.00	2.31
74	002085	万丰奥威	8,697,919.00	2.31
75	601988	中国银行	8,628,402.00	2.29

76	002142	宁波银行	8,526,184.43	2.27
77	002756	永兴材料	8,453,745.88	2.25
78	600873	梅花生物	8,349,282.00	2.22
79	002299	圣农发展	8,308,294.90	2.21
80	000625	长安汽车	8,297,911.34	2.21
81	601225	陕西煤业	8,125,485.00	2.16
82	601615	明阳智能	8,101,800.00	2.15
83	603236	移远通信	8,062,123.08	2.14
84	688099	晶晨股份	8,013,161.45	2.13
85	603317	天味食品	7,963,397.20	2.12
86	300363	博腾股份	7,948,729.00	2.11
87	605117	德业股份	7,913,420.00	2.10
88	002920	德赛西威	7,799,133.00	2.07
89	688303	大全能源	7,777,480.17	2.07
90	000933	神火股份	7,660,212.00	2.04

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

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值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	29,701,844.00	7.90
2	300750	宁德时代	27,703,193.00	7.37
3	603868	飞科电器	25,586,833.00	6.80
4	002594	比亚迪	23,574,038.00	6.27
5	601318	中国平安	23,567,349.00	6.27
6	000568	泸州老窖	22,950,978.00	6.10
7	600036	招商银行	22,349,286.00	5.94
8	600188	兖矿能源	21,356,483.16	5.68
9	601088	中国神华	21,117,882.57	5.62

10	002129	TCL中环	20,266,031.00	5.39
11	002705	新宝股份	17,626,717.20	4.69
12	600256	广汇能源	17,031,956.70	4.53
13	600887	伊利股份	16,448,363.57	4.37
14	603259	药明康德	16,326,691.00	4.34
15	600690	海尔智家	16,115,293.84	4.29
16	600438	通威股份	15,988,337.75	4.25
17	600499	科达制造	15,038,783.00	4.00
18	600863	内蒙华电	14,956,016.00	3.98
19	600089	特变电工	14,802,925.12	3.94
20	601166	兴业银行	14,625,480.00	3.89
21	002460	赣锋锂业	14,361,142.22	3.82
22	002240	盛新锂能	13,780,718.00	3.66
23	000651	格力电器	13,260,189.00	3.53
24	002497	雅化集团	13,213,697.00	3.51
25	603799	华友钴业	13,195,812.65	3.51
26	300769	德方纳米	13,172,264.23	3.50
27	600809	山西汾酒	12,971,873.06	3.45
28	600905	三峡能源	12,963,668.00	3.45
29	601012	隆基绿能	12,716,072.43	3.38
30	000567	海德股份	12,701,933.62	3.38
31	002466	天齐锂业	12,607,922.52	3.35
32	002304	洋河股份	12,298,258.00	3.27
33	000792	盐湖股份	12,166,418.00	3.24
34	601238	广汽集团	11,379,880.02	3.03
35	601328	交通银行	11,160,353.68	2.97
36	300316	晶盛机电	11,111,449.83	2.96
37	601838	成都银行	11,010,657.00	2.93
38	002371	北方华创	10,909,972.00	2.90
39	000625	长安汽车	10,903,863.20	2.90
40	601919	中远海控	10,806,178.83	2.87

41	603392	万泰生物	10,771,207.65	2.86
42	300861	美畅股份	10,511,738.60	2.80
43	300390	天华超净	10,326,091.52	2.75
44	688556	高测股份	10,225,229.80	2.72
45	002142	宁波银行	10,006,134.00	2.66
46	002756	永兴材料	9,940,325.08	2.64
47	000553	安道麦A	9,908,636.64	2.64
48	601898	中煤能源	9,856,927.00	2.62
49	603127	昭衍新药	9,855,938.25	2.62
50	600873	梅花生物	9,836,838.00	2.62
51	603659	璞泰来	9,753,027.40	2.59
52	600233	圆通速递	9,677,932.66	2.57
53	000858	五粮液	9,643,996.00	2.56
54	601615	明阳智能	9,627,803.00	2.56
55	601699	潞安环能	9,577,851.00	2.55
56	002179	中航光电	9,497,832.00	2.53
57	600160	巨化股份	9,480,736.60	2.52
58	002050	三花智控	9,468,556.06	2.52
59	601857	中国石油	9,342,878.43	2.48
60	603529	爱玛科技	9,338,673.80	2.48
61	603198	迎驾贡酒	9,252,454.20	2.46
62	600039	四川路桥	9,218,089.90	2.45
63	002459	晶澳科技	9,029,079.60	2.40
64	002085	万丰奥威	8,930,944.00	2.38
65	601899	紫金矿业	8,911,448.00	2.37
66	300628	亿联网络	8,871,892.54	2.36
67	603613	国联股份	8,871,646.39	2.36
68	603986	兆易创新	8,808,937.00	2.34
69	603345	安井食品	8,783,912.42	2.34
70	603236	移远通信	8,730,716.20	2.32
71	600030	中信证券	8,711,492.05	2.32

72	300363	博腾股份	8,703,974.00	2.31
73	002709	天赐材料	8,678,559.00	2.31
74	603317	天味食品	8,660,876.60	2.30
75	300775	三角防务	8,660,710.00	2.30
76	002839	张家港行	8,636,771.50	2.30
77	000921	海信家电	8,547,427.65	2.27
78	601225	陕西煤业	8,530,919.00	2.27
79	603185	上机数控	8,415,793.60	2.24
80	600132	重庆啤酒	8,371,813.00	2.23
81	300073	当升科技	8,368,964.05	2.23
82	688099	晶晨股份	8,244,814.92	2.19
83	603323	苏农银行	8,194,809.30	2.18
84	603876	鼎胜新材	8,150,186.00	2.17
85	688122	西部超导	8,133,214.77	2.16
86	300833	浩洋股份	8,069,547.71	2.15
87	600348	华阳股份	8,018,087.00	2.13
88	688303	大全能源	7,977,568.27	2.12
89	002920	德赛西威	7,950,256.89	2.11
90	688063	派能科技	7,884,056.25	2.10
91	603688	石英股份	7,874,754.96	2.09
92	000733	振华科技	7,864,110.50	2.09
93	000933	神火股份	7,801,363.00	2.07
94	603290	斯达半导	7,764,317.01	2.06
95	603589	口子窖	7,733,930.00	2.06
96	600157	永泰能源	7,657,846.00	2.04

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。

8.4.3 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	3,244,019,782.92
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	3,296,091,796.85
--------------	------------------

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。

8.5 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	11,728,771.64	4.74
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	11,728,771.64	4.74

8.6 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	019666	22国债01	110,000	11,222,305.48	4.53
2	019638	20国债09	5,000	506,466.16	0.20

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

在法律法规允许的范围内，本基金基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，根据风险管理原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金在本报告期内按照相关法律法规的规定，以套期保值为目的进行股指期货投资，在一定程度上对冲了系统性风险、流动性风险对基金的影响，降低了基金净值的波动。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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) 2022年8月22日，中国平安保险（集团）股份有限公司（股票代码601318）因未按照规定进行国际收支统计申报，收到国家外汇监管局责令改正、给予警告，处罚款人民币30万元的行政处罚决定（深外管检〔2022〕23号）。

2022年3月21日，招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，股票代码600036）因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在十三项违法违规行为，收到中国银保监会罚款300万元的行政处罚决定（银保监罚决字〔2022〕21号）。2022年8月31日，招商银行因违反账户管理规定等十三项违法行为，收到中国人民银行警告，没收违法所得5.692641万元，罚款3423.5万元的行政处罚决定（银罚决字〔2022〕1号）。2022年9月9日，招商银行因个人经营贷款挪用至房地产市场、个人经营贷款“三查”不到位、总行对分支机构管控不力承担管理责任，收到中国银保监会罚款460万元的行政处罚决定（银保监罚决字〔2022〕48号）。

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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	6,372.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,372.30

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息**9.1 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	3,721	41,700.68	33,237,775.81	21.42%	121,930,462.03	78.58%
博道久航混合C	2,493	24,745.21	1,000,200.00	1.62%	60,689,598.78	98.38%
合计	6,064	35,761.55	34,237,975.81	15.79%	182,620,060.81	84.21%

9.2 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	13.51	0.00%
	博道久航混合C	2,377.62	0.00%
	合计	2,391.13	0.00%

9.3 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

§10 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	184,412,453.17	71,158,593.29
本报告期基金总申购份额	4,690,142.40	20,604,904.40
减：本报告期基金总赎回份额	33,934,357.73	30,073,698.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	155,168,237.84	61,689,798.78

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。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：无。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：本次报告期内，基金托管人兴业证券于2022年11月4日聘任王波同志担任资产托管部副总经理。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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)，本期审计费用请见"7.4.7.17其他费用"。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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
兴业证券	2	6,514,030,881.66	100.00%	4,242,239.51	100.00%	-

11.7.2 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	20,608,364.52	100.00%	76,003,000.00	100.00%	-	-	-	-

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；
 - (4) 具有较强的为投资人提供资产配置及服务的能力，包括但不限于：产品筛选及评审流程完整，具有较为完善的资产配置，客户服务及陪伴体系等。
- 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。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博道基金管理有限公司关于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	2022-01-01
2	博道基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	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	2022-01-20
3	博道基金管理有限公司旗下全部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	2022-01-24
4	博道久航混合型证券投资基金2021年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-24
5	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金关联方承销证券的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-29
6	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	2022-03-05
7	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	2022-03-31
8	博道久航混合型证券投资基金2021年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-31
9	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券股份有限公司为销售机构的公告	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	2022-04-15
10	博道基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证券报、	2022-04-16

	网上直销汇款交易相关业务调整的公告	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	
11	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	2022-04-22
12	博道久航混合型证券投资基金2022年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-22
13	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商银行股份有限公司为销售机构的公告	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	2022-05-18
14	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-05-20
15	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	2022-06-22
16	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构的公告	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	2022-07-11
17	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构的公告	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	2022-07-14
18	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	2022-07-21
19	博道久航混合型证券投资基金2022年第二季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-07-21

20	博道基金管理有限公司关于北京分公司营业场所变更的公告	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	2022-08-13
21	博道基金管理有限公司旗下部分基金中期报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-08-31
22	博道久航混合型证券投资基金2022年中期报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-08-31
23	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	2022-09-14
24	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	2022-10-26
25	博道久航混合型证券投资基金2022年第三季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-10-26
26	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为销售机构的公告	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	2022-11-09
27	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	2022-11-15
28	博道基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	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	2022-11-23
29	博道久航混合型证券投资基金（更新）招募说明书（2022年第1号）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-26
30	博道久航混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-11-26

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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
无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。自2022年1月1日起本基金已完成新金融工具准则的切换。鉴于本基金业务的性质,新金融工具准则未对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

§13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

13.3 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
二〇二三年三月三十一日