

博道研究恒选混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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:国泰君安证券股份有限公司

送出日期:2023 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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	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	12
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	14
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 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
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 本基金投资股指期货的投资政策	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	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64

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	64
§9 开放式基金份额变动	65
§10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
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 影响投资者决策的其他重要信息	68
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	68
§12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道研究恒选混合型证券投资基金	
基金简称	博道研究恒选混合	
基金主代码	015104	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年06月02日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	72,772,993.46份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道研究恒选混合A	博道研究恒选混合C
下属分级基金的交易代码	015104	015105
报告期末下属分级基金的份额总额	59,185,915.10份	13,587,078.36份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求超越基金业绩比较基准的投资回报和基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略，在长期战略资产配置保持稳定的前提下，结合对国内外宏观经济形势的综合分析，确定合适的短期战术配置比例，动态优化投资组合。基于基金管理人研究团队对中长期趋势研究和量化的中短期行业景气度跟踪相结合，确定各行业配置比例；系统化吸收基金管理人研究团队重点推荐并融合股票基本面多因子选股思路，优选基本面良好的个股并动态调整个股配置权重。此外，本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，重点关注基本面良好、估值合理、具有持续核心竞争力的公司。本基金债券投资策略主要包括久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、

	杠杆放大策略和换券等多种策略。本基金的可转换债券和可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略和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×70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博道基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛	帅芳
	联系电话	021-80226288	021-38037354
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	shuaifang@gtjas.com
客户服务电话		400-085-2888	021-38917599-5
传真		021-80226289	021-38031815
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	上海市静安区新闸路669号博华广场19楼
邮政编码		200122	200041
法定代表人		莫泰山	贺青

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网	www.bdfund.cn

址	
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 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	博道研究恒选混合 A	博道研究恒选混合 C
本期已实现收益	-2,247,702.87	-551,682.11
本期利润	-1,164,126.56	-285,807.67
加权平均基金份额本期利润	-0.0192	-0.0199
本期加权平均净值利润率	-2.10%	-2.19%
本期基金份额净值增长率	-2.19%	-2.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	-6,729,348.44	-1,609,110.77
期末可供分配基金份额利润	-0.1137	-0.1184
期末基金资产净值	52,456,566.66	11,977,967.59
期末基金份额净值	0.8863	0.8816
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-11.37%	-11.84%

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

博道研究恒选混合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	3.06%	0.84%	0.76%	0.62%	2.30%	0.22%
过去三个月	-3.94%	0.75%	-3.47%	0.58%	-0.47%	0.17%
过去六个月	-2.19%	0.76%	0.35%	0.59%	-2.54%	0.17%
过去一年	-13.51%	0.81%	-8.74%	0.70%	-4.77%	0.11%
自基金合同生效起至今	-11.37%	0.79%	-2.83%	0.71%	-8.54%	0.08%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

博道研究恒选混合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	3.03%	0.84%	0.76%	0.62%	2.27%	0.22%
过去三个月	-4.06%	0.76%	-3.47%	0.58%	-0.59%	0.18%
过去六个月	-2.41%	0.76%	0.35%	0.59%	-2.76%	0.17%
过去一年	-13.94%	0.81%	-8.74%	0.70%	-5.20%	0.11%
自基金合同生效起至今	-11.84%	0.79%	-2.83%	0.71%	-9.01%	0.08%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

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

博道研究恒选混合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
(2022年06月02日-2023年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2022年6月2日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。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。

博道研究恒选混合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
(2022年06月02日-2023年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2022年6月2日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。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25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、博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金、博道惠泰优选混合型证券投资基金和博道和祥多元稳健债券型证券投资基金。

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		
何晓彬	博道研究恒选混合的基金经理、研究副总监兼研究部总经理、专户投资二部总经理	2022-06-02	-	19年	何晓彬先生，中国籍，经济学博士。2004年7月至2005年8月担任长城基金管理有限公司金融工程研究员，2006年3月至2010年6

				月担任交银施罗德基金管理有限公司金融工程部门总经理助理，2010年10月至2012年6月担任上海凯石投资管理有限公司金融工程部门总监，2012年7月至2014年6月担任交银施罗德基金管理有限公司专户投资部门副总经理、投资经理，2014年7月至2017年7月担任上海博道投资管理有限公司量化高级投资经理。2017年8月加入博道基金管理有限公司，现任研究副总监兼研究部总经理、专户投资二部总经理，同时兼任私募资产管理计划投资经理。具有基金从业资格。自2022年6月2日起担任博道研究恒选混合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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
何晓彬	公募基金	1	64,434,534.25	2022-06-02
	私募资产管理计划	2	33,695,136.45	2018-02-23
	其他组合	-	-	-
	合计	3	98,129,670.70	-

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8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

2023年上半年，市场波动略超市场预期，一季度疫后经济修复A股走强，但进入二季度，市场预期走弱风险偏好回摆，股市基本抹平了年初的涨幅。上半年沪深300下跌0.75%、中证500上涨2.29%、中证1000上涨5.10%、恒生指数下跌4.37%。从行业来看，通信、传媒、计算机、家电、机械表现较好，分别上涨45.41%、43.43%、32.27%、17.42%、12.97%，消费者服务、房地产表现较差，分别下跌27.92%、14.07%。

去年底市场预期先行，市场交易国内政策转向和美联储加息放缓，风险偏好处于持续提升的阶段，2-3月经济修复兑现，国内经济环比动能呈现放缓趋势，市场风险偏好开始回落，上半年市场呈现出“预期先行兑现反转”的特征。当前市场对经济复苏预期重回较悲观的位置，权益配置的赔率重新变高。

开年阶段经济的恢复性增长带动经济环比明显改善，这种脉冲式的需求释放在3月告一段落，而经济内生动能仍处于低位缓慢爬升的阶段，两者叠加使得经济看似相对弱势，在与年初预期形成一定落差后市场又反过来将短期波动线性外推形成长期悲观预期。而政策在二季度低基数下保持定力，整体处于观察期，使得市场部分乐观政策预期

有所落空。展望后市，二季度讨论的所谓“通缩”问题虽然有长期因素在，但短期看更可能是“去库存”周期尾声的因素影响更大，因此价格下行压力最大的阶段大概率在二季度，下半年有望见底回升，带动经济内生动能趋势出现一定程度的复苏，从而扭转市场长期问题短期化的悲观预期。

本基金报告期间坚持系统化基本面投资框架，以长期竞争力选股、量化行业优选、量化风格优选等多策略复合配置，辅助小幅仓位管理平滑组合波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，由于市场在中长期担忧下对短周期拐点越来越谨慎，需要更多的数据和更持续的改善做验证，所以权益市场的短期拐点需要更多的耐心，相信随着库存压力的释放，低库存最终也将积蓄力量，更敏感地反应需求端的边际好转，基本面中期的趋势依然向好。

本基金将继续发挥公司研究基础设施在主动研究和量化选股等方面超额收益能力的积累，借助系统化方式从不同基本面收益来源分域构造多元策略复合配置，聚焦中大盘成长风格选股，力争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

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在博道研究恒选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博道研究恒选混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,683,498.73	5,225,415.74

结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	61,642,310.27	64,754,191.70
其中：股票投资		58,096,328.07	58,553,756.38
基金投资		-	-
债券投资		3,545,982.20	6,200,435.32
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,199,638.35	-
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		3,506.08	-
应收申购款		87,036.10	1,297.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		64,615,989.53	69,980,904.48
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		-	-
应付赎回款		-	3,541.15
应付管理人报酬		78,819.85	89,350.07
应付托管费		13,136.63	14,891.63
应付销售服务费		4,898.44	5,849.95
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	84,600.36	80,003.35
负债合计		181,455.28	193,636.15
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	72,772,993.46	77,067,075.06
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-8,338,459.21	-7,279,806.73
净资产合计		64,434,534.25	69,787,268.33
负债和净资产总计		64,615,989.53	69,980,904.48

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：博道研究恒选混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年06月02日（基金 合同生效日）至2022 年06月30日
一、营业总收入		-752,966.80	5,839,346.53
1.利息收入		32,415.58	274,653.23
其中：存款利息收入	6.4.7.9	16,286.42	58,791.26
债券利息收入		-	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		16,129.16	215,861.97
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,138,574.80	1,114,182.99
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,740,903.98	968,130.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	47,330.56	17,742.48
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	554,998.62	128,310.33
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）	6.4.7.15	1,349,450.75	3,987,066.86
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,741.67	463,443.45
减：二、营业总支出		696,967.43	412,994.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	510,026.16	284,775.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	85,004.32	47,462.53
3. 销售服务费		32,512.57	64,418.87
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产		-	-

支出			
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		0.02	-
8. 其他费用	6.4.7.17	69,424.36	16,338.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,449,934.23	5,426,351.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,449,934.23	5,426,351.75
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,449,934.23	5,426,351.75

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博道研究恒选混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30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）	77,067,075.06	-	-7,279,806.73	69,787,268.33
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）	77,067,075.06	-	-7,279,806.73	69,787,268.33
三、本期增减变	-4,294,081.60	-	-1,058,652.48	-5,352,734.08

动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	-1,449,934.23	-1,449,934.23
（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）	-4,294,081.60	-	391,281.75	-3,902,799.85
其中：1.基金申购款	1,043,285.95	-	-66,999.52	976,286.43
2.基金赎回款	-5,337,367.55	-	458,281.27	-4,879,086.28
（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）	72,772,993.46	-	-8,338,459.21	64,434,534.25
项目	上年度可比期间			
	2022年06月02日（基金合同生效日）至2022年06月30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）	-	-	-	-
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）	252,531,700.62	-	-	252,531,700.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-89,787,772.13	-	3,991,911.96	-85,795,860.17
（一）、综合收益总额	-	-	5,426,351.75	5,426,351.75
（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）	-89,787,772.13	-	-1,434,439.79	-91,222,211.92
其中：1.基金申购款	602,126.38	-	11,289.91	613,416.29
2.基金赎回款	-90,389,898.51	-	-1,445,729.70	-91,835,628.21
（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）	162,743,928.49	-	3,991,911.96	166,735,840.45

值)				
----	--	--	--	--

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

博道研究恒选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[2022]187号《关于准予博道研究恒选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《博道研究恒选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252,457,001.88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（2022）第0338号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道研究恒选混合型证券投资基金基金合同》于2022年6月2日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为252,531,700.62份基金份额，其中认购资金利息折合74,698.74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，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

根据《博道研究恒选混合型证券投资基金基金合同》和《博道研究恒选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《博道研究恒选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、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、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会

相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%(其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的0%-50%)。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金以后,基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或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×70%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%+中债综合全价(总值)指数收益率×25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《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》、《博道研究恒选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2023年01月01日至2023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2023年06月30日的财务状况以及2023年01月01日至2023年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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。

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

沪港通或深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	999,476.17
等于：本金	999,024.72
加：应计利息	451.45
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	684,022.56
等于：本金	683,887.42
加：应计利息	135.14
减：坏账准备	-
合计	1,683,498.73

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 2023年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	58,647,934.25	-	58,096,328.07	-551,606.18	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,501,692.91	35,482.29	3,545,982.20	8,807.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,501,692.91	35,482.29	3,545,982.20	8,807.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	62,149,627.16	35,482.29	61,642,310.27	-542,799.18	

注：如果本报告期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。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,199,638.35	-
银行间市场	-	-
合计	1,199,638.35	-

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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	9,916.99
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	15,176.00
合计	84,600.36

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 博道研究恒选混合A

金额单位：人民币元

项目 (博道研究恒选混合A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	61,921,680.32	61,921,680.32
本期申购	597,953.20	597,953.20
本期赎回(以“-”号填列)	-3,333,718.42	-3,333,718.42
本期末	59,185,915.10	59,185,915.10

6.4.7.7.2 博道研究恒选混合C

金额单位：人民币元

项目 (博道研究恒选混合C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
-------------------	-------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,145,394.74	15,145,394.74
本期申购	445,332.75	445,332.75
本期赎回（以“-”号填列）	-2,003,649.13	-2,003,649.13
本期末	13,587,078.36	13,587,078.36

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。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 博道研究恒选混合A

单位：人民币元

项目 (博道研究恒选混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-3,237,984.36	-2,579,518.77	-5,817,503.13
本期利润	-2,247,702.87	1,083,576.31	-1,164,126.56
本期基金份额交易产生的变动数	150,102.05	102,179.20	252,281.25
其中：基金申购款	-34,598.98	-1,686.43	-36,285.41
基金赎回款	184,701.03	103,865.63	288,566.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,335,585.18	-1,393,763.26	-6,729,348.44

6.4.7.8.2 博道研究恒选混合C

单位：人民币元

项目 (博道研究恒选混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-831,575.72	-630,727.88	-1,462,303.60
本期利润	-551,682.11	265,874.44	-285,807.67
本期基金份额交易产生的变动数	94,751.10	44,249.40	139,000.50
其中：基金申购款	-23,711.65	-7,002.46	-30,714.11

基金赎回款	118,462.75	51,251.86	169,714.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,288,506.73	-320,604.04	-1,609,110.77

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
活期存款利息收入	12,180.03	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	4,106.39	
结算备付金利息收入	-	
其他	-	
合计	16,286.42	

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
卖出股票成交总额	186,690,754.43	
减：卖出股票成本总额	188,930,738.55	
减：交易费用	500,919.86	
买卖股票差价收入	-2,740,903.98	

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
债券投资收益——利息收入	38,787.47	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,543.09	

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	47,330.56

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,294,818.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,163,988.32
减：应计利息总额	122,274.36
减：交易费用	13.01
买卖债券差价收入	8,543.09

6.4.7.12 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。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	554,998.62
基金投资产生的股利收益	-
合计	554,998.62

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	1,349,450.75
——股票投资	1,333,604.79
——债券投资	15,845.96
——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	1,349,450.75

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	3,741.53
转换费收入	0.14
合计	3,741.67

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。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	9,916.99
信息披露费	59,507.37
合计	69,424.36

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

根据本基金的基金管理人于2023年8月12日公布的《博道基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告》，经与各基金托管人协商一致，决定自2023年8月14日起，调低旗下部分基金的管理费率和/或托管费率。调整后本基金管理费率和托管费率分别为1.20%和0.20%，本次调整将减少本基金在同等规模下所需承担支付的管理费和托管费。

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
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年06月02日（基金合同生效日）
-------	-------------------------------	---------------------------------

			至2022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
国泰君安证券股份有限公司	373,538,379.49	100.00%	82,914,191.26	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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年06月02日（基金合同生效日） 至2022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
国泰君安证券股份有限公司	4,067,248.77	100.00%	13,411,007.00	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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年06月02日（基金合同生效日） 至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交	成交金额	占当期债券回购成交

		总额的 比例		总额的 比例
国泰君安 证券股份 有限公司	178,602,000.00	100.00%	3,237,100,000.00	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 2023年01月01日至2023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
国泰君安 证券股份 有限公司	270,596.05	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年06月02日（基金合同生效日）至2022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
国泰君安 证券股份 有限公司	59,819.95	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	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年01月01日 至2023年06月30 日	2022年06月02日（基金合同 生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	510,026.16	284,775.36
其中：支付销售机构的客户维护费	115,007.70	94,645.07

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 2023年01月01日 至2023年06月30 日	上年度可比期间 2022年06月02日（基金合同生 效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	85,004.32	47,462.53

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 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道研究恒选混合A	博道研究恒选混合C	合计
博道基金 管理有限 公司	0.00	2,310.27	2,310.27
国泰君安 证券股份 有限公司	0.00	22,605.89	22,605.89
合计	0.00	24,916.16	24,916.16

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年06月02日（基金合同生效日）至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道研究恒选混合A	博道研究恒选混合C	合计
博道基金管理有限公司	0.00	394.97	394.97
国泰君安证券股份有限公司	0.00	60,473.16	60,473.16
合计	0.00	60,868.13	60,868.13

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。

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

博道研究恒选混合A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年06月30日	2022年06月02日（基金合同生效日）至2022年06月30日
基金合同生效日（2022年06月02日）持有的基金份额	0.00	29,008,135.00
报告期初持有的基金份额	29,008,135.00	0.00
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	29,008,135.00	29,008,135.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	49.01%	37.40%

博道研究恒选混合C

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01 日至2023年06 月30日	上年度可比期间 2022年06月02日（基金 合同生效日）至2022年0 6月30日
基金合同生效日（2022年06月02日）持有的基金份额	0.00	1,000,315.00
报告期初持有的基金份额	1,000,315.00	0.00
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	1,000,315.00	1,000,315.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.36%	1.17%

注：

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；
- 3、如果本报告期间发生认购、申购、转换入、红利再投、赎回、转换出等业务，本基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间大于100万份。（上年度末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间大于100万份。）

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2023年01月01日至2023年06月30日		2022年06月02日（基金合同生效日） 至2022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
国泰君安 证券股份 有限公司	684,022.56	4,106.39	37,457,436.91	10,503.62

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

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（2023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：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111014	李子转债	2023-06-21	1个月内（含）	配债未上市	100.00	100.01	70	6,999.91	7,000.42	-

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	停牌原	期末估	复牌日	复牌开	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	-----	-----	-----	-----	-----	-------	--------	--------	----

码	称	期	因	值 单 价	期	盘 单 价				
199 5	旭 辉 永 升 服 务	202 3-0 3-3 1	重 大 事 项	2.8 1	-	-	194,000	605,661.46	545,535.57	-

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人国泰君安证券开立于兴业银行股份有限公司的托管账户，其他存款存放于国泰君安证券，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2023年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.01%（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）。

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2023年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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2023年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.86%。

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2023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64,059,875.23元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金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、债券投资和买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	1,683,498.73	-	-	-	-	-	1,683,498.73
交易性金融资产	-	-	3,538,981.78	-	7,000.42	58,096,328.07	61,642,310.27
买入返售金融资产	1,199,638.35	-	-	-	-	-	1,199,638.35
应收股利	-	-	-	-	-	3,506.08	3,506.08
应收申购款	-	-	-	-	-	87,036.10	87,036.10
资产总计	2,883,137.08	-	3,538,981.78	-	7,000.42	58,186,870.25	64,615,989.53
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	78,819.85	78,819.85
应付托管费	-	-	-	-	-	13,136.63	13,136.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,898.44	4,898.44
其他负债	-	-	-	-	-	84,600.36	84,600.36
负债总计	-	-	-	-	-	181,455.28	181,455.28
利率敏感度缺口	2,883,137.08	-	3,538,981.78	-	7,000.42	58,005,414.97	64,434,534.25
上年度末 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	5,225,415.74	-	-	-	-	-	5,225,415.74
交易性金融资产	3,060,628.77	-	3,139,806.55	-	-	58,553,756.38	64,754,191.70
应收申购款	-	-	-	-	-	1,297.04	1,297.04
资产总计	8,286,044.51	-	3,139,806.55	-	-	58,555,053.42	69,980,904.48
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,541.15	3,541.15
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	89,350.07	89,350.07
应付托	-	-	-	-	-	14,891.63	14,891.63

管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,849.95	5,849.95
其他负债	-	-	-	-	-	80,003.35	80,003.35
负债总计	-	-	-	-	-	193,636.15	193,636.15
利率敏感度缺口	8,286,044.51	-	3,139,806.55	-	-	58,361,417.27	69,787,268.33

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2023年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为5.50% (2022年12月31日：8.88%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响 (2022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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	4,175,679.69	-	4,175,679.69
应收股利	-	3,506.08	-	3,506.08
资产合计	-	4,179,185.77	-	4,179,185.77
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	4,179,185.77	-	4,179,185.77

项目	上年度末 2022年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	3,883,375.20	-	3,883,375.20
资产合计	-	3,883,375.20	-	3,883,375.20
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	3,883,375.20	-	3,883,375.20

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	1.所有外币相对人民币升值5%	208,959.29	194,168.76
	2.所有外币相对人民币贬值5%	-208,959.29	-194,168.76

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60%-95%(其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的0%-50%)。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金以后，现金或到期日在

一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022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	58,096,328.07	90.16	58,553,756.38	83.90
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	58,096,328.07	90.16	58,553,756.38	83.90

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日

1.业绩比较基准收益率 上升5%	3,035,893.27	3,181,786.15
2.业绩比较基准收益率 下降5%	-3,035,893.27	-3,181,786.15

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	57,550,792.50	58,553,756.38
第二层次	4,091,517.77	6,200,435.32
第三层次	-	-
合计	61,642,310.27	64,754,191.70

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	58,096,328.07	89.91
	其中：股票	58,096,328.07	89.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,545,982.20	5.49
	其中：债券	3,545,982.20	5.49
	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	1,199,638.35	1.86
	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	1,683,498.73	2.61
8	其他各项资产	90,542.18	0.14
9	合计	64,615,989.53	100.00

注：1、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；

2、本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值及占基金资产净值比例请见“7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合”部分披露。

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	515,373.00	0.80
B	采矿业	562,984.00	0.87
C	制造业	36,258,870.18	56.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,302,171.00	2.02
E	建筑业	783,503.00	1.22
F	批发和零售业	830,583.00	1.29
G	交通运输、仓储和邮政业	959,744.20	1.49
H	住宿和餐饮业	165,126.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,969,289.40	7.71
J	金融业	4,028,543.00	6.25
K	房地产业	508,143.00	0.79
L	租赁和商务服务业	975,628.00	1.51
M	科学研究和技术服务业	729,952.00	1.13
N	水利、环境和公共设施管理业	108,345.00	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	756,733.60	1.17
R	文化、体育和娱乐业	465,660.00	0.72
S	综合	-	-
	合计	53,920,648.38	83.68

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
可选消费	1,540,880.28	2.39
医药卫生	260,735.94	0.40
信息技术	456,215.98	0.71

通信服务	1,372,311.92	2.13
房地产	545,535.57	0.85
合计	4,175,679.69	6.48

注：以上分类采用中证CICS一级分类标准编制。

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	600519	贵州茅台	1,300	2,198,300.00	3.41
2	300750	宁德时代	6,820	1,560,347.80	2.42
3	300274	阳光电源	9,500	1,107,985.00	1.72
4	601318	中国平安	20,800	965,120.00	1.50
5	600887	伊利股份	30,600	866,592.00	1.34
6	0700	腾讯控股	2,800	856,039.99	1.33
7	000333	美的集团	13,800	813,096.00	1.26
8	002352	顺丰控股	15,600	703,404.00	1.09
9	000063	中兴通讯	11,500	523,710.00	0.81
9	0763	中兴通讯	6,200	179,491.07	0.28
10	600036	招商银行	20,800	681,408.00	1.06
11	688111	金山办公	1,400	661,108.00	1.03
12	688012	中微公司	4,125	645,356.25	1.00
13	3690	美团-W	5,710	643,849.06	1.00
14	600276	恒瑞医药	13,400	641,860.00	1.00
15	603688	石英股份	5,600	637,504.00	0.99
16	300015	爱尔眼科	30,992	574,901.60	0.89
17	002459	晶澳科技	13,700	571,290.00	0.89
18	1995	旭辉永升服务	194,000	545,535.57	0.85
19	000858	五粮液	3,200	523,424.00	0.81
20	300760	迈瑞医疗	1,600	479,680.00	0.74

21	300059	东方财富	32,100	455,820.00	0.71
22	002594	比亚迪	1,700	439,059.00	0.68
23	603259	药明康德	7,000	436,170.00	0.68
24	600150	中国船舶	13,100	431,121.00	0.67
25	002555	三七互娱	11,700	408,096.00	0.63
26	002230	科大讯飞	6,000	407,760.00	0.63
27	002595	豪迈科技	11,400	400,482.00	0.62
28	002422	科伦药业	13,100	388,808.00	0.60
29	688277	天智航	21,000	387,240.00	0.60
30	603027	千禾味业	18,164	383,623.68	0.60
31	601669	中国电建	66,100	379,414.00	0.59
32	002027	分众传媒	54,200	369,102.00	0.57
33	1368	特步国际	50,000	367,870.02	0.57
34	600690	海尔智家	14,800	347,504.00	0.54
35	600633	浙数文化	19,900	322,579.00	0.50
36	600129	太极集团	5,400	321,246.00	0.50
37	600438	通威股份	9,300	319,083.00	0.50
38	000625	长安汽车	23,900	309,027.00	0.48
39	002254	泰和新材	12,400	303,428.00	0.47
40	601012	隆基绿能	10,500	301,035.00	0.47
41	601888	中国中免	2,700	298,431.00	0.46
42	300751	迈为股份	1,760	298,108.80	0.46
43	000768	中航西飞	11,000	294,250.00	0.46
44	600557	康缘药业	10,400	285,584.00	0.44
45	600761	安徽合力	14,000	279,020.00	0.43
46	603059	倍加洁	12,100	275,154.00	0.43
47	2015	理想汽车-W	2,200	274,842.24	0.43
48	600309	万华化学	3,100	272,304.00	0.42
49	600863	内蒙华电	65,600	272,240.00	0.42
50	002582	好想你	34,600	270,226.00	0.42
51	002011	盾安环境	19,500	269,685.00	0.42

52	603596	伯特利	3,400	269,484.00	0.42
53	301015	百洋医药	9,600	266,496.00	0.41
54	603486	科沃斯	3,400	264,418.00	0.41
55	000862	银星能源	34,500	264,270.00	0.41
56	000301	东方盛虹	22,200	262,404.00	0.41
57	605305	中际联合	7,500	261,450.00	0.41
58	000999	华润三九	4,300	260,838.00	0.40
59	9926	康方生物	8,000	260,735.94	0.40
60	002414	高德红外	33,540	260,605.80	0.40
61	603816	顾家家居	6,800	259,420.00	0.40
62	600600	青岛啤酒	2,500	259,075.00	0.40
63	002299	圣农发展	13,400	256,610.00	0.40
64	600641	万业企业	13,400	255,806.00	0.40
65	6862	海底捞	16,000	254,318.96	0.39
66	600926	杭州银行	21,600	253,800.00	0.39
67	002968	新大正	16,700	252,337.00	0.39
68	601838	成都银行	20,600	251,526.00	0.39
69	600031	三一重工	15,100	251,113.00	0.39
70	688696	极米科技	1,800	250,902.00	0.39
71	002304	洋河股份	1,900	249,565.00	0.39
72	002603	以岭药业	9,700	249,193.00	0.39
73	600066	宇通客车	16,800	247,632.00	0.38
74	688378	奥来德	5,000	247,000.00	0.38
75	300986	志特新材	8,800	246,400.00	0.38
76	1810	小米集团—W	24,600	243,137.19	0.38
77	603129	春风动力	1,500	242,850.00	0.38
78	000860	顺鑫农业	7,200	242,568.00	0.38
79	002129	TCL中环	7,225	239,870.00	0.37
80	300476	胜宏科技	9,900	238,689.00	0.37
81	002415	海康威视	7,200	238,392.00	0.37
82	0941	中国移动	4,000	236,211.28	0.37

83	002368	太极股份	5,700	234,669.00	0.36
84	688599	天合光能	5,501	234,397.61	0.36
85	300049	福瑞股份	10,000	230,000.00	0.36
86	300454	深信服	2,000	226,500.00	0.35
87	605599	菜百股份	16,900	223,249.00	0.35
88	603345	安井食品	1,500	220,200.00	0.34
89	601689	拓普集团	2,700	217,890.00	0.34
90	300496	中科创达	2,200	211,970.00	0.33
91	300014	亿纬锂能	3,500	211,750.00	0.33
92	603369	今世缘	4,000	211,200.00	0.33
93	300494	盛天网络	8,280	205,261.20	0.32
94	300253	卫宁健康	18,800	203,416.00	0.32
95	601688	华泰证券	14,600	201,042.00	0.31
96	600900	长江电力	8,900	196,334.00	0.30
97	600030	中信证券	9,900	195,822.00	0.30
98	600588	用友网络	9,000	184,500.00	0.29
99	300314	戴维医疗	8,600	181,804.00	0.28
100	002487	大金重工	5,800	178,872.00	0.28
101	600011	华能国际	19,200	177,792.00	0.28
102	300058	蓝色光标	18,100	175,027.00	0.27
103	600089	DR特变电	7,600	169,404.00	0.26
104	600754	锦江酒店	3,900	165,126.00	0.26
105	300624	万兴科技	1,400	164,010.00	0.25
106	002832	比音勒芬	4,600	162,886.00	0.25
107	300866	安克创新	1,800	157,500.00	0.24
108	000651	格力电器	4,200	153,342.00	0.24
109	000425	徐工机械	22,600	153,002.00	0.24
110	002865	钧达股份	999	152,377.47	0.24
111	601601	中国太保	5,800	150,684.00	0.23
112	688120	华海清科	596	150,221.80	0.23
113	601985	中国核电	21,300	150,165.00	0.23

114	301035	润丰股份	1,900	149,283.00	0.23
115	301039	中集车辆	11,200	148,176.00	0.23
116	601225	陕西煤业	8,100	147,339.00	0.23
117	603551	奥普家居	11,200	144,816.00	0.22
118	601088	中国神华	4,700	144,525.00	0.22
119	002271	东方雨虹	5,200	141,752.00	0.22
120	601898	中煤能源	16,600	140,104.00	0.22
121	601800	中国交建	12,800	139,648.00	0.22
122	003816	中国广核	44,600	138,706.00	0.22
123	603529	爱玛科技	4,300	138,546.00	0.22
124	002568	百润股份	3,800	138,130.00	0.21
125	300408	三环集团	4,700	137,945.00	0.21
126	300532	今天国际	6,700	137,752.00	0.21
127	688080	映翰通	2,800	136,920.00	0.21
128	002847	盐津铺子	1,600	136,080.00	0.21
129	688212	澳华内镜	2,000	135,800.00	0.21
130	601169	北京银行	29,200	135,196.00	0.21
131	300896	爱美客	300	133,485.00	0.21
132	600415	小商品城	15,600	133,068.00	0.21
133	601006	大秦铁路	17,900	132,997.00	0.21
134	601618	中国中冶	33,500	132,995.00	0.21
135	600612	老凤祥	1,900	132,772.00	0.21
136	600919	江苏银行	17,900	131,565.00	0.20
137	601668	中国建筑	22,900	131,446.00	0.20
138	600028	中国石化	20,600	131,016.00	0.20
139	301029	怡合达	2,880	128,678.40	0.20
140	601009	南京银行	16,000	128,000.00	0.20
141	600197	伊力特	4,700	127,699.00	0.20
142	002956	西麦食品	8,100	126,603.00	0.20
143	300856	科思股份	1,600	126,032.00	0.20
144	601728	中国电信	22,300	125,549.00	0.19

145	300271	华宇软件	11,300	125,204.00	0.19
146	300622	博士眼镜	5,300	125,080.00	0.19
147	300232	洲明科技	13,500	123,390.00	0.19
148	301101	明月镜片	3,000	123,090.00	0.19
149	601816	京沪高铁	23,400	123,084.00	0.19
150	603019	中科曙光	2,400	122,160.00	0.19
151	301096	百诚医药	2,000	121,220.00	0.19
152	300633	开立医疗	2,200	119,900.00	0.19
153	688551	科威尔	1,800	118,044.00	0.18
154	600535	天士力	7,900	114,629.00	0.18
155	300206	理邦仪器	7,600	114,608.00	0.18
156	300316	晶盛机电	1,600	113,440.00	0.18
157	600809	山西汾酒	600	111,042.00	0.17
158	002475	立讯精密	3,400	110,330.00	0.17
159	600419	天润乳业	6,700	108,674.00	0.17
160	301239	普瑞眼科	1,100	107,888.00	0.17
161	002311	海大集团	2,300	107,732.00	0.17
162	0909	明源云	33,000	106,792.94	0.17
163	0268	金蝶国际	11,000	106,285.85	0.16
164	000568	泸州老窖	500	104,785.00	0.16
165	002410	广联达	3,220	104,617.80	0.16
166	002050	三花智控	3,400	102,884.00	0.16
167	300842	帝科股份	1,100	100,584.00	0.16
168	9990	祖龙娱乐	27,000	100,569.58	0.16
169	000596	古井贡酒	400	98,952.00	0.15
170	601628	中国人寿	2,800	97,888.00	0.15
171	600537	亿晶光电	12,800	97,792.00	0.15
172	002223	鱼跃医疗	2,700	97,173.00	0.15
173	688777	中控技术	1,520	95,425.60	0.15
174	002371	北方华创	300	95,295.00	0.15
175	300693	盛弘股份	2,544	93,924.48	0.15

176	688390	固德威	560	93,441.60	0.15
177	300100	双林股份	10,000	92,800.00	0.14
178	300680	隆盛科技	3,700	92,019.00	0.14
179	600060	海信视像	3,700	91,575.00	0.14
180	002261	拓维信息	4,600	88,826.00	0.14
181	002334	英威腾	6,700	85,358.00	0.13
182	000776	广发证券	5,800	85,318.00	0.13
183	301257	普蕊斯	1,500	84,300.00	0.13
184	600211	西藏药业	1,400	83,160.00	0.13
185	301339	通行宝	3,300	82,929.00	0.13
186	603298	杭叉集团	3,500	82,425.00	0.13
187	300718	长盛轴承	3,700	82,325.00	0.13
188	603859	能科科技	1,600	81,808.00	0.13
189	300342	天银机电	7,500	80,775.00	0.13
190	002905	金逸影视	7,800	80,574.00	0.13
191	601177	杭齿前进	6,600	80,520.00	0.12
192	002454	松芝股份	9,500	80,465.00	0.12
193	603630	拉芳家化	5,000	79,850.00	0.12
194	002139	拓邦股份	6,100	79,605.00	0.12
195	605337	李子园	4,350	79,518.00	0.12
196	002266	浙富控股	18,900	78,057.00	0.12
197	600237	铜峰电子	9,400	77,362.00	0.12
198	002381	双箭股份	10,000	77,200.00	0.12
199	603040	新坐标	2,900	77,111.00	0.12
200	600517	国网英大	13,500	76,950.00	0.12
201	000409	云鼎科技	7,600	75,924.00	0.12
202	600570	恒生电子	1,700	75,293.00	0.12
203	002434	万里扬	8,400	75,180.00	0.12
204	603518	锦泓集团	6,600	74,910.00	0.12
205	603121	华培动力	8,400	74,844.00	0.12
206	688617	惠泰医疗	200	74,750.00	0.12

207	603758	秦安股份	7,000	74,480.00	0.12
208	603368	柳药集团	3,000	74,130.00	0.12
209	603103	横店影视	4,400	74,096.00	0.11
210	300539	横河精密	5,000	74,050.00	0.11
211	002367	康力电梯	8,100	73,953.00	0.11
212	002044	美年健康	10,400	73,944.00	0.11
213	600784	鲁银投资	10,200	73,848.00	0.11
214	002094	青岛金王	20,200	73,730.00	0.11
215	300308	中际旭创	500	73,725.00	0.11
216	601515	东风股份	16,800	73,584.00	0.11
217	603158	腾龙股份	9,600	73,536.00	0.11
218	002698	博实股份	4,200	73,458.00	0.11
219	002772	众兴菌业	6,500	73,450.00	0.11
220	002017	东信和平	5,590	73,284.90	0.11
221	300667	必创科技	3,700	72,853.00	0.11
222	002739	万达电影	5,800	72,732.00	0.11
223	603166	福达股份	10,700	72,118.00	0.11
224	301208	中亦科技	1,300	71,929.00	0.11
225	300817	双飞股份	4,800	71,760.00	0.11
226	002593	日上集团	18,500	71,595.00	0.11
227	002651	利君股份	9,200	71,484.00	0.11
227	002394	联发股份	8,400	71,484.00	0.11
229	600728	佳都科技	10,300	71,379.00	0.11
230	600858	银座股份	11,800	71,272.00	0.11
231	603299	苏盐井神	7,100	70,858.00	0.11
232	300984	金沃股份	2,700	70,821.00	0.11
233	603725	天安新材	8,700	70,731.00	0.11
234	003017	大洋生物	2,100	70,665.00	0.11
235	603020	爱普股份	7,700	70,532.00	0.11
236	300092	科新机电	4,300	70,520.00	0.11
237	002274	华昌化工	9,400	70,406.00	0.11

238	000759	中百集团	15,600	70,356.00	0.11
239	002533	金杯电工	8,600	70,176.00	0.11
240	300033	同花顺	400	70,112.00	0.11
241	002734	利民股份	7,600	70,072.00	0.11
242	301011	华立科技	2,990	70,055.70	0.11
243	002976	瑞玛精密	2,500	69,925.00	0.11
244	603628	清源股份	4,400	69,652.00	0.11
245	002929	润建股份	1,600	69,456.00	0.11
246	603600	永艺股份	7,300	69,423.00	0.11
247	002937	兴瑞科技	2,800	68,880.00	0.11
248	000707	双环科技	8,100	68,850.00	0.11
249	605077	华康股份	2,600	68,848.00	0.11
250	300927	江天化学	4,200	68,754.00	0.11
251	300796	贝斯美	5,700	68,571.00	0.11
252	002580	圣阳股份	7,300	68,547.00	0.11
253	603161	科华控股	4,700	68,479.00	0.11
254	000731	四川美丰	8,400	68,460.00	0.11
255	300239	东宝生物	11,100	68,376.00	0.11
256	603601	再升科技	16,000	68,320.00	0.11
257	002613	北玻股份	14,700	68,061.00	0.11
258	300773	拉卡拉	3,900	68,016.00	0.11
259	002233	塔牌集团	8,800	67,936.00	0.11
260	300231	银信科技	7,600	67,716.00	0.11
261	002588	史丹利	11,100	67,488.00	0.10
262	300533	冰川网络	1,350	67,446.00	0.10
263	002860	星帅尔	5,000	67,400.00	0.10
264	002056	横店东磁	3,700	67,377.00	0.10
265	605166	聚合顺	7,200	67,104.00	0.10
266	603833	欧派家居	700	67,060.00	0.10
267	603351	威尔药业	2,500	67,050.00	0.10
268	600598	北大荒	5,000	66,650.00	0.10

269	601519	大智慧	9,300	66,588.00	0.10
270	002131	利欧股份	28,900	66,470.00	0.10
271	002154	报喜鸟	12,000	66,240.00	0.10
272	601098	中南传媒	5,700	66,120.00	0.10
273	603365	水星家纺	4,700	66,082.00	0.10
274	000822	山东海化	9,700	66,057.00	0.10
275	002912	中新赛克	1,500	66,015.00	0.10
276	605259	绿田机械	1,700	65,994.00	0.10
277	603587	地素时尚	4,500	65,880.00	0.10
278	002737	葵花药业	2,700	65,718.00	0.10
279	003006	百亚股份	3,800	65,664.00	0.10
280	000158	常山北明	8,100	65,529.00	0.10
281	002458	益生股份	5,300	65,455.00	0.10
282	002940	昂利康	3,400	65,314.00	0.10
283	300130	新国都	2,300	65,159.00	0.10
284	300636	同和药业	5,300	64,978.00	0.10
285	002398	垒知集团	11,300	64,410.00	0.10
286	300326	凯利泰	9,700	63,050.00	0.10
287	603083	剑桥科技	1,000	62,890.00	0.10
288	002852	道道全	4,800	62,064.00	0.10
289	600702	舍得酒业	500	61,975.00	0.10
290	300413	芒果超媒	1,800	61,578.00	0.10
291	300837	浙矿股份	1,600	61,440.00	0.10
292	300638	广和通	2,580	58,514.40	0.09
293	600757	长江传媒	6,800	58,480.00	0.09
294	002351	漫步者	2,800	57,904.00	0.09
295	300745	欣锐科技	1,300	57,421.00	0.09
296	603156	养元饮品	2,200	54,340.00	0.08
297	300972	万辰生物	1,200	53,208.00	0.08
298	688410	山外山	1,000	52,500.00	0.08
299	300144	宋城演艺	4,200	52,080.00	0.08

300	002803	吉宏股份	2,500	51,150.00	0.08
301	688009	中国通号	8,600	49,880.00	0.08
302	603444	吉比特	100	49,111.00	0.08
303	601336	新华保险	1,300	47,801.00	0.07
304	300124	汇川技术	700	44,947.00	0.07
305	300957	贝泰妮	500	44,440.00	0.07
306	603605	珀莱雅	380	42,712.00	0.07
307	600803	新奥股份	2,200	41,756.00	0.06
308	603868	飞科电器	600	37,854.00	0.06
309	002517	恺英网络	2,200	34,628.00	0.05
310	688556	高测股份	611	32,468.54	0.05
311	600839	四川长虹	6,100	30,805.00	0.05
312	600167	联美控股	4,400	30,668.00	0.05
313	600406	国电南瑞	1,320	30,492.00	0.05
314	600323	瀚蓝环境	1,600	30,288.00	0.05
315	600008	首创环保	10,500	30,240.00	0.05
316	600436	片仔癀	100	28,636.00	0.04
317	601717	郑煤机	2,300	28,635.00	0.04
318	600481	双良节能	1,800	25,164.00	0.04
319	688006	杭可科技	800	24,376.00	0.04
320	002429	兆驰股份	4,400	24,200.00	0.04
321	300418	昆仑万维	600	24,168.00	0.04
322	600582	天地科技	3,900	22,737.00	0.04
323	002602	世纪华通	2,600	19,734.00	0.03
324	603288	海天味业	340	15,929.00	0.02
325	600837	海通证券	1,700	15,674.00	0.02
326	000661	长春高新	100	13,630.00	0.02
327	300122	智飞生物	300	13,260.00	0.02
328	601766	中国中车	1,900	12,350.00	0.02
329	600660	福耀玻璃	300	10,755.00	0.02
330	000338	潍柴动力	800	9,968.00	0.02

331	600104	上汽集团	700	9,919.00	0.02
332	002812	恩捷股份	100	9,635.00	0.01
333	002202	金风科技	900	9,558.00	0.01
334	600999	招商证券	700	9,499.00	0.01
335	603899	晨光股份	200	8,928.00	0.01
336	600958	东方证券	900	8,730.00	0.01
337	601615	明阳智能	500	8,440.00	0.01
338	601877	正泰电器	300	8,295.00	0.01
339	002709	天赐材料	200	8,238.00	0.01
340	300142	沃森生物	300	7,935.00	0.01
341	300347	泰格医药	100	6,454.00	0.01
342	301153	中科江南	60	4,497.60	0.01
343	300553	集智股份	30	1,703.40	0.00
344	688798	艾为电子	22	1,301.30	0.00
345	688687	凯因科技	39	1,150.50	0.00
346	300765	新诺威	40	515.60	0.00
347	603355	莱克电气	15	381.15	0.00
348	603565	中谷物流	24	259.20	0.00
349	600050	中国联通	34	163.20	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	600050	中国联通	2,533,442.34	3.63
2	601318	中国平安	2,141,249.00	3.07
3	300750	宁德时代	1,988,137.00	2.85
4	002459	晶澳科技	1,839,431.00	2.64
5	300274	阳光电源	1,709,625.00	2.45
6	000768	中航西飞	1,656,814.00	2.37

7	600900	长江电力	1,651,949.00	2.37
8	300628	亿联网络	1,557,803.00	2.23
9	000063	中兴通讯	1,557,555.00	2.23
10	600519	贵州茅台	1,401,477.00	2.01
11	603688	石英股份	1,375,047.00	1.97
12	002410	广联达	1,364,851.00	1.96
13	002487	大金重工	1,353,206.00	1.94
14	300454	深信服	1,337,216.00	1.92
15	688390	固德威	1,273,124.48	1.82
16	600031	三一重工	1,227,923.00	1.76
17	600887	伊利股份	1,221,638.00	1.75
18	000596	古井贡酒	1,191,710.00	1.71
19	300986	志特新材	1,175,144.00	1.68
20	002968	新大正	1,155,140.40	1.66

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	600050	中国联通	3,226,602.00	4.62
2	601318	中国平安	2,538,272.00	3.64
3	600031	三一重工	2,339,254.00	3.35
4	300750	宁德时代	2,282,281.00	3.27
5	300628	亿联网络	2,233,543.00	3.20
6	601668	中国建筑	2,154,764.00	3.09
7	300274	阳光电源	1,969,977.00	2.82
8	000333	美的集团	1,705,340.00	2.44
9	600150	中国船舶	1,690,374.00	2.42
10	601888	中国中免	1,652,140.00	2.37

11	603606	东方电缆	1,616,909.52	2.32
12	002459	晶澳科技	1,520,121.97	2.18
13	600900	长江电力	1,470,931.70	2.11
14	000768	中航西飞	1,404,200.00	2.01
15	300136	信维通信	1,399,372.00	2.01
16	601689	拓普集团	1,391,485.00	1.99
17	002487	大金重工	1,356,633.00	1.94
18	002410	广联达	1,351,220.00	1.94
19	300454	深信服	1,301,120.00	1.86
20	688390	固德威	1,298,252.39	1.86

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	187,087,553.48
卖出股票收入（成交）总额	186,690,754.43

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	3,538,981.78	5.49
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)	7,000.42	0.01
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	3,545,982.20	5.50

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	019694	23国债01	20,000	2,022,192.88	3.14
2	019688	22国债23	15,000	1,516,788.90	2.35
3	111014	李子转债	70	7,000.42	0.01

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

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）2022年8月22日，中国平安保险（集团）股份有限公司（证券代码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）。

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	应收清算款	-
3	应收股利	3,506.08
4	应收利息	-
5	应收申购款	87,036.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	90,542.18

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。

58 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
博道研究恒选混合A	724	81,748.50	29,056,962.73	49.09%	30,128,952.37	50.91%
博道研究恒选混合C	610	22,273.90	1,000,315.00	7.36%	12,586,763.36	92.64%
合计	1,311	55,509.53	30,057,277.73	41.30%	42,715,715.73	58.70%

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	博道研究恒选混合A	2,653,686.50	4.48%
	博道研究恒选混合C	23,664.13	0.17%
	合计	2,677,350.63	3.68%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	博道研究恒选混合A	>100
	博道研究恒选混合C	0
	合计	>100

本基金基金经理持有本开放式基金	博道研究恒选混合 A	>100
	博道研究恒选混合 C	0
	合计	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道研究恒选混合A	博道研究恒选混合C
基金合同生效日(2022年06月02日)基金份额总额	79,187,405.71	173,344,294.91
本报告期期初基金份额总额	61,921,680.32	15,145,394.74
本报告期基金总申购份额	597,953.20	445,332.75
减：本报告期基金总赎回份额	3,333,718.42	2,003,649.13
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	59,185,915.10	13,587,078.36

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未发生重大人事变动。

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

10.6.1 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。

10.6.2 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。

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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券	2	373,538,379.49	100.00%	270,596.05	100.00%	-

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
国泰君安证券	4,067,248.77	100.00%	178,602,000.00	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。

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	2023-01-20
2	博道研究恒选混合型证券投资基金2022年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20
3	博道基金管理有限公司关于调整旗下部分基金2023年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务安排的公告	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	2023-03-15
4	博道基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2023-03-31
5	博道研究恒选混合型证券投资基金2022年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
6	博道基金管理有限公司关于调整“特定投资群体”（养老金客户）适用范围的公告	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	2023-04-04

7	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	2023-04-21
8	博道研究恒选混合型证券投资基金2023年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-21
9	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加北京雪球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	2023-05-04
10	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	2023-06-06
11	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-14

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230101-20230630	30,008,450.00	-	-	30,008,450.00	41.24%
产品特有风险							
<p>本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。</p>							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道研究恒选混合型证券投资基金募集注册的文件；

- 2、《博道研究恒选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道研究恒选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道研究恒选混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道研究恒选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、报告期内博道研究恒选混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站（www.bdfund.cn）查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博道基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-085-2888（免长途话费）。

博道基金管理有限公司
二〇二三年八月三十一日