

博道久航混合型证券投资基金

2023 年年度报告

2023 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:2024 年 03 月 29 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2024年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2023年01月01日起至2023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	10
§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	17
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 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25
§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	69
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	88
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	97
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	98
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	98
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	98
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	98
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	98

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	99
8.12 投资组合报告附注.....	99
§9 基金份额持有人信息.....	99
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	99
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	100
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.....	100
§10 开放式基金份额变动.....	101
§11 重大事件揭示.....	101
11.1 基金份额持有人大会决议.....	101
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.....	101
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	101
11.4 基金投资策略的改变.....	101
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	102
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.....	102
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	102
11.8 其他重大事件.....	103
§12 备查文件目录.....	106
12.1 备查文件目录.....	106
12.2 存放地点.....	106
12.3 查阅方式.....	106

§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	357,582,585.16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	191,756,184.97份	165,826,400.19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	2023年		2022年		2021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	451,227.40	-656,489.32	-50,524,025.71	-20,195,505.61	64,006,263.70	25,523,568.17
本期利润	4,599,743.35	2,310,414.56	-56,597,565.61	-21,817,035.29	25,143,886.37	11,560,123.87
加权平均基金份额本期利润	0.0323	0.0312	-0.3358	-0.3161	0.1005	0.1154
本期加权平均净值利润率	2.76%	2.72%	-26.35%	-25.12%	6.99%	8.09%
本期基金份额净值增长率	0.96%	0.46%	-22.28%	-22.67%	6.18%	5.65%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末		2022年末		2021年末	
期末可供分配利润	30,242,431.06	22,327,293.89	22,765,818.04	7,985,417.63	87,678,694.17	32,770,133.66
期末可供分配基金份额利润	0.1577	0.1346	0.1467	0.1294	0.4754	0.4605
期末基金资产净值	221,998,616.03	188,153,694.08	177,934,055.88	69,675,216.41	272,091,147.34	103,928,726.95
期末基金份额净值	1.1577	1.1346	1.1467	1.1294	1.4754	1.4605
3.1.3 累计期末指标	2023年末		2022年末		2021年末	
基金份额累计净值增长率	15.77%	13.46%	14.67%	12.94%	47.54%	46.05%

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	-0.68%	0.75%	-4.96%	0.63%	4.28%	0.12%
过去六个月	-1.89%	0.75%	-8.05%	0.66%	6.16%	0.09%
过去一年	0.96%	0.73%	-7.58%	0.65%	8.54%	0.08%
过去三年	-16.68%	1.04%	-22.58%	0.85%	5.90%	0.19%
自基金合同生效起至今	15.77%	1.10%	-3.35%	0.94%	19.12%	0.16%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

博道久航混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.80%	0.75%	-4.96%	0.63%	4.16%	0.12%
过去六个月	-2.13%	0.75%	-8.05%	0.66%	5.92%	0.09%
过去一年	0.46%	0.73%	-7.58%	0.65%	8.04%	0.08%
过去三年	-17.93%	1.04%	-22.58%	0.85%	4.65%	0.19%
自基金合同生效起至今	13.46%	1.10%	-3.35%	0.94%	16.81%	0.16%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

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

博道久航混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年12月24日-2023年12月31日)



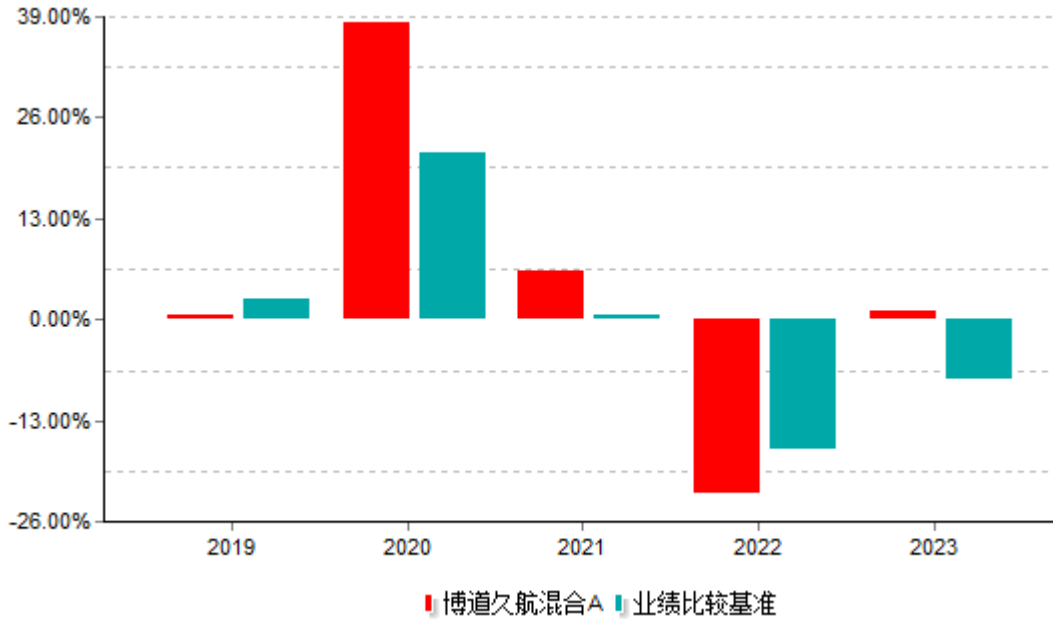
注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

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-2023年12月31日)

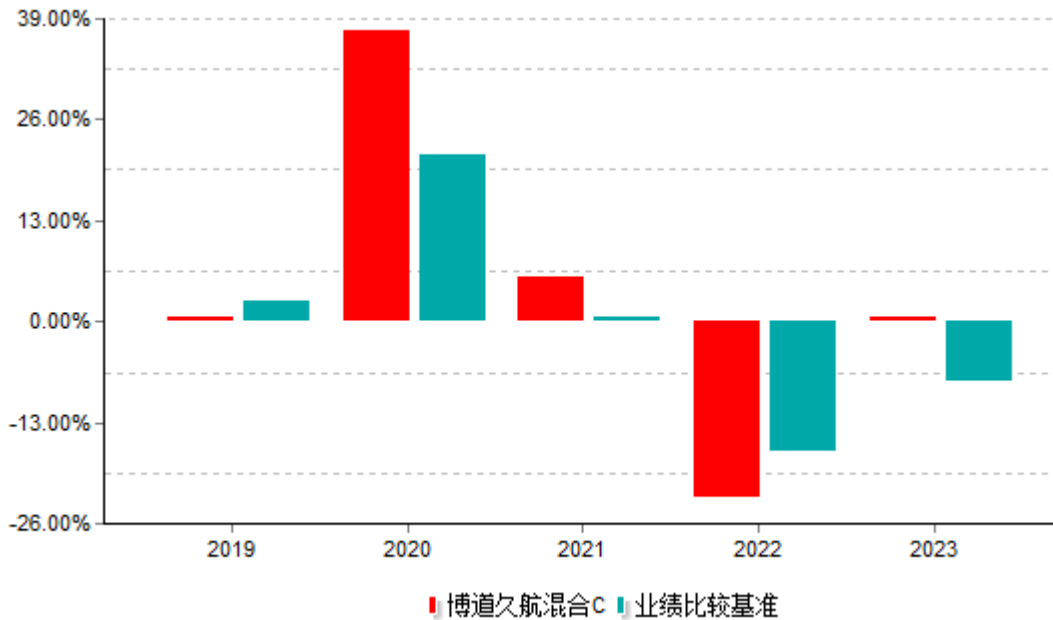


注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

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：基金合同生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。



注：基金合同生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

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28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个月持有期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、博道和祥多元稳健债券型证券投资基金、博道中证1000指数增强型证券投资基金、博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金和博道红利智航股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨梦	博道启航混合、博道中证500增强、博道沪深300增强、博道远航混合、博道叁佰智航、博道伍佰智航、博道久航混合、博道消费智航、博道成长智航股票、博道	2019-12-24	-	12年	杨梦女士，中国籍，经济学硕士。2011年7月至2014年6月担任农银汇理基金管理有限公司量化研究员，2014年6月至2014年11月担任华泰资产管理有限公司量化研究员，2014年11月至2017年7月担任上海博道投资管

	<p>中证1000指数增强、博道红利智航股票的基金经理、量化投资部总经理、研究部副总经理</p>			<p>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股票型证券投资基金基金经理至今、自2023年8月25日起担任博道中证1000指数增强型证券投资基金基金经理至今、自2023年10月31日起担任博道红利</p>
--	--	--	--	--

					智航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10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，国内经济和海外流动性两大因素主导市场波动，各指数在低估区域继续弱势。全年沪深300下跌11.38%，中证500下跌7.42%，中证1000下跌6.28%，上证指数下跌3.70%，创业板指下跌19.41%，恒生指数下跌13.82%。从行业来看，通信、传媒、煤炭表现较好，分别上涨了24.78%、19.84%、13.39%，消费者服务、房地产、电力设备新能源表现较差，分别下跌41.18%、24.80%、24.65%。

从因子层面来看，2023年是个非“典型”年份，基本面类的因子全年表现都相对弱势，在传统容易有所表现的二、三季度并未录得较好超额，在容易波动的四季度反而表现相对平稳；而估值因子和量价因子因表征反转逻辑，在存量博弈的2023年持续表现亮眼。博道“指数+”系列产品在相对均衡的因子权重配置下，持续深耕底层大类因子的有效迭代，全年超额表现较好。2023年二季度开始，博道量化团队进行了AI全流程投资模型的研发，并在三季度陆续开始在各量化产品中进行运用，10月底开始，传统框架多因子模型与AI全流程多因子模型以各自约一半的权重参与博道“指数+”系列产品的实盘。

报告期间，本基金于7月初对产品的配置策略进行了改进，从配置中证800多因子选股增强模型（不受指数成分股占比约束的版本），升级为配置于“学习优秀主动选股基

金”的几种SMART BETA选股策略，以更好地实现产品的运作目标，力争为组合获取相对偏股混合型基金指数有竞争力的超额收益。策略升级以来，运作效果较好。

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2024年，基于赔率的视角，股市股权风险溢价再度达到2倍标准差的水平，债券市场的期限利率和信用利差也已经被压到极致；基于胜率的视角，我们监测的股票市场基本面从时间和空间的角度都已大概率接近底部。虽然很难精准预测股债资产溢价何时回归，但方向是明确的，耐心更加可贵。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023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及其适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

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

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本次报告期内，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职责，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合规守信、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(2024)第26533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2023年12月31日的资产负债表,2023年度的利润表和净资产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</p>

	<p>)、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2023年12月31日的财务状况以及2023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。</p> <p>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</p>

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。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(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。

(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。

(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。

(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。

(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。

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。
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	叶尔甸、李隐煜
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	2024-03-22

§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：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	25,777,441.76	8,071,419.27
结算备付金		62,902.36	62,142.97
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	384,953,992.46	240,519,808.19
其中：股票投资		363,820,709.45	228,791,036.55
基金投资		-	-
债券投资		21,133,283.01	11,728,771.64
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	-	-
应收清算款		-	-

应收股利		-	-
应收申购款		107,801.79	6,372.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		410,902,138.37	248,659,742.73
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		60,618.67	472,892.74
应付管理人报酬		391,349.14	323,429.82
应付托管费		65,224.84	53,904.94
应付销售服务费		72,634.77	30,240.24
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	160,000.84	170,002.70
负债合计		749,828.26	1,050,470.44
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	357,582,585.16	216,858,036.62
未分配利润	7.4.7.8	52,569,724.95	30,751,235.67
净资产合计		410,152,310.11	247,609,272.29
负债和净资产总计		410,902,138.37	248,659,742.73

注：报告截止日2023年12月31日，A类基金份额净值1.1577元，C类基金份额净值1.1346元；基金份额总额357,582,585.16份，其中A类基金份额191,756,184.97份，C类基金份额165,826,400.19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：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2 022年12月31日
一、营业总收入		11,491,817.66	-72,517,230.30
1.利息收入		120,926.88	133,113.57
其中：存款利息收入	7.4.7.9	120,926.65	133,113.35
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		0.23	0.22
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		4,232,389.57	-64,969,116.18
其中：股票投资收益	7.4.7.10	1,063,722.70	-69,398,149.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	271,203.37	376,540.50
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	2,897,463.50	4,338,594.13
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	7,115,419.83	-7,695,069.58
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	23,081.38	13,841.89
减：二、营业总支出		4,581,659.75	5,897,370.60
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	3,426,572.02	4,535,899.23
2.托管费	7.4.10.2.2	571,095.33	755,983.26
3.销售服务费		421,620.58	435,257.22
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		12,371.02	10,230.71
其中：卖出回购金融资产支出		12,371.02	10,230.71
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		0.45	0.18
8.其他费用	7.4.7.17	150,000.35	160,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,910,157.91	-78,414,600.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,910,157.91	-78,414,600.90
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,910,157.91	-78,414,600.90

7.3 净资产变动表

会计主体：博道久航混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	216,858,036.62	30,751,235.67	247,609,272.29
二、本期期初净资产	216,858,036.62	30,751,235.67	247,609,272.29

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	140,724,548.54	21,818,489.28	162,543,037.82
（一）、综合收益总额	-	6,910,157.91	6,910,157.91
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	140,724,548.54	14,908,331.37	155,632,879.91
其中：1.基金申购款	204,462,042.98	26,272,599.17	230,734,642.15
2.基金赎回款	-63,737,494.44	-11,364,267.80	-75,101,762.24
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	357,582,585.16	52,569,724.95	410,152,310.11
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	255,571,046.46	120,448,827.83	376,019,874.29
二、本期期初净资产	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净资产变动数(净资产减少以“-”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净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	216,858,036.62	30,751,235.67	247,609,272.29

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2024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2023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2023年12月31日的财务状况以及2023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

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业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商业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。

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

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。

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

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。

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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外), 按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	3,202,508.57	2,548,779.57
等于：本金	3,201,103.25	2,547,626.14
加：应计利息	1,405.32	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	22,574,933.19	5,522,639.70
等于：本金	22,570,074.65	5,521,272.06
加：应计利息	4,858.54	1,367.64
减：坏账准备	-	-
合计	25,777,441.76	8,071,419.27

注：其他存款本期末及上年度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 2023年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	360,255,259.00	-	363,820,709.45	3,565,450.45	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	20,919,794.00	163,943.01	21,133,283.01	49,546.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	20,919,794.00	163,943.01	21,133,283.01	49,546.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	381,175,053.00	163,943.01	384,953,992.46	3,614,996.45	
项目	上年度末 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	

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

无。

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

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.84	2.70

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	30,000.00	40,000.00
预提费用-信息披露费	130,000.00	130,000.00
合计	160,000.84	170,002.70

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 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	155,168,237.84	155,168,237.84
本期申购	85,438,310.17	85,438,310.17
本期赎回（以“-”号填列）	-48,850,363.04	-48,850,363.04
本期末	191,756,184.97	191,756,184.97

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 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	61,689,798.78	61,689,798.78
本期申购	119,023,732.81	119,023,732.81
本期赎回（以“-”号填列）	-14,887,131.40	-14,887,131.40
本期末	165,826,400.19	165,826,400.19

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
上年度末	46,860,392.16	-24,094,574.12	22,765,818.04
本期期初	46,860,392.16	-24,094,574.12	22,765,818.04
本期利润	451,227.40	4,148,515.95	4,599,743.35
本期基金份额交易产生的变动数	10,253,701.32	-7,376,831.65	2,876,869.67
其中：基金申购款	26,354,804.90	-14,171,214.25	12,183,590.65
基金赎回款	-16,101,103.58	6,794,382.60	-9,306,720.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,565,320.88	-27,322,889.82	30,242,431.06

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
上年度末	17,495,988.01	-9,510,570.38	7,985,417.63
本期期初	17,495,988.01	-9,510,570.38	7,985,417.63
本期利润	-656,489.32	2,966,903.88	2,310,414.56
本期基金份额交易产生的变动数	28,962,602.18	-16,931,140.48	12,031,461.70
其中：基金申购款	33,278,511.01	-19,189,502.49	14,089,008.52
基金赎回款	-4,315,908.83	2,258,362.01	-2,057,546.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,802,100.87	-23,474,806.98	22,327,293.89

7.4.7.9 存款利息收入

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 12月31日	2022年01月01日至2022年 12月31日
活期存款利息收入	41,545.97	37,608.99
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	78,621.29	90,585.99
结算备付金利息收入	759.39	4,918.37
其他	-	-
合计	120,926.65	133,113.35

7.4.7.10 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 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	2,921,306,410.24	3,296,091,796.85
减：卖出股票成本总额	2,913,802,025.72	3,357,572,342.06
减：交易费用	6,440,661.82	7,917,604.33
买卖股票差价收入	1,063,722.70	-69,398,149.54

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 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	181,612.16	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	89,591.21	87,363.95
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	271,203.37	376,540.50

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 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	22,213,892.13	24,131,877.67
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	21,725,780.64	23,501,842.37
减：应计利息总额	398,479.02	542,649.23
减：交易费用	41.26	22.12
买卖债券差价收入	89,591.21	87,363.95

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

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

无。

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 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022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 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
股票投资产生的股利收益	2,897,463.50	4,338,594.13
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,897,463.50	4,338,594.13

7.4.7.15 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12 月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
1.交易性金融资产	7,115,419.83	-7,695,069.58
——股票投资	7,057,573.83	-7,754,769.58
——债券投资	57,846.00	59,700.00
——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	7,115,419.83	-7,695,069.58

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
----	-----------------------------------	--

基金赎回费收入	23,051.96	13,796.52
转换费收入	29.42	45.37
合计	23,081.38	13,841.89

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 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	30,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
存托服务费	0.35	-
合计	150,000.35	160,000.00

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	5,950,949,784.26	100.00%	6,514,030,881.66	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
兴业证券	33,207,257.50	100.00%	20,608,364.52	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 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	118,704,000.00	100.00%	76,003,000.00	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 2023年01月01日至2023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	3,697,297.35	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%	-	-

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 2023年01月01日至20	上年度可比期间 2022年01月01日至20

	23年12月31日	22年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,426,572.02	4,535,899.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,212,110.60	1,668,438.59
应支付基金管理人的净管理费	2,214,461.42	2,867,460.64

注:1、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%/1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、根据基金管理人发布的《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》，自2023年8月14日起，本基金管理费率由1.50%调整为1.20%。

7.4.10.2.2 基金托管费

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12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	571,095.33	755,983.26

注:1、支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.25%/0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、根据基金管理人发布的《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》，自2023年8月14日起，本基金托管费率由0.25%调整为0.20%。

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		
	2023年01月01日至2023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	-	59,799.04	59,799.04

兴业证券	-	146,006.09	146,006.09
合计	-	205,805.13	205,805.13
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 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 公司	-	7,943.59	7,943.59
兴业证券	-	197,475.92	197,475.92
合计	-	205,419.51	205,419.51

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

无。

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 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022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	1.04%	1.29%

例		
---	--	--

博道久航混合C

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12月31日	2022年01月01日至 2022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	0.60%	1.62%

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

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0~10万份。（上年度末，除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。）

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	
	2023年01月01日至2023年12月31日		2022年01月01日至2022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	22,574,933.19	78,621.29	5,522,639.70	90,585.99

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 2023年01月01日至2023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	688435	英方软件	网下发行	2,508	96,959.28
兴业证券	301419	阿莱德	网下发行	3,292	81,641.60
兴业证券	688469	中芯集成	网下发行	23,942	136,229.98
兴业证券	301315	威士顿	网下发行	1,697	54,796.13
兴业证券	601916	浙商银行	配股	148,050	299,061.00
兴业证券	301578	辰奕智能	网下发行	1,175	57,504.50
上年度可比期间 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

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2023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
301487	盟固利	2023-08-01	6个月以上	创业板打新限售	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301526	国际复材	2023-12-19	6个月以上	创业板打新限售	2.66	4.45	5,752	15,300.32	25,596.40	-
301348	蓝箭电子	2023-08-01	6个月以上	创业板打新限售	18.08	44.57	377	6,816.16	16,802.89	-
300904	威力传动	2023-08-02	6个月以上	创业板打新限售	35.41	61.53	264	9,348.24	16,243.92	-
301510	固高科技	2023-08-04	6个月以上	创业板打新限售	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
688652	京仪装备	2023-11-22	6个月以上	科创板打新限售	31.95	52.25	253	8,083.35	13,219.25	-
301421	波长光电	2023-08-16	6个月以上	创业板打新限售	29.38	59.37	216	6,346.08	12,823.92	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月以	创业板打	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-

			上	新限售						
301558	三态股份	2023-09-21	6个月以上	创业板打新限售	7.33	13.40	869	6,369.77	11,644.60	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月以上	创业板打新限售	39.78	69.09	165	6,563.70	11,399.85	-
601096	宏盛华源	2023-12-15	6个月以上	主板打新限售	1.70	4.06	2,773	4,714.10	11,258.38	-
301508	中机认检	2023-11-23	6个月以上	创业板打新限售	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301172	君逸数码	2023-07-19	6个月以上	创业板打新限售	31.33	38.16	292	9,148.36	11,142.72	-
688627	精智达	2023-07-11	6个月以上	科创板打新限售	46.77	87.72	124	5,799.48	10,877.28	-
688653	康希通信	2023-11-10	6个月以上	科创板打新限售	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688592	司南导航	2023-08-07	6个月以上	科创板打新限售	50.50	50.53	200	10,100.00	10,106.00	-

688548	广钢气体	2023-08-08	6个月以上	科创板打新限售	9.87	12.75	783	7,728.21	9,983.25	-
301370	国科恒泰	2023-07-03	6个月以上	创业板打新限售	13.39	16.01	611	8,181.29	9,782.11	-
301413	安培龙	2023-12-11	6个月以上	创业板打新限售	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
688549	中巨芯	2023-08-30	6个月以上	科创板打新限售	5.18	8.09	1,172	6,070.96	9,481.48	-
301516	中远通	2023-12-01	6个月以上	创业板打新限售	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301499	维科精密	2023-07-13	6个月以上	创业板打新限售	19.50	28.93	314	6,123.00	9,084.02	-
301568	思泰克	2023-11-21	6个月以上	创业板打新限售	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月以上	科创板打新限售	26.74	38.67	219	5,856.06	8,468.73	-
301372	科净	2023-08-03	6个	创业	45.00	43.59	194	8,730.00	8,456.46	-

	源		月以上	板打 新限售							
6885 63	航材 股份	2023- 07-12	6个 月以 上	科创 板打 新限售	78.99	60.49	137	10,82 1.63	8,28 7.13	-	
3014 59	丰茂 股份	2023- 12-06	6个 月以 上	创业 板打 新限售	31.90	39.84	208	6,63 5.20	8,28 6.72	-	
6887 20	艾森 股份	2023- 11-29	6个 月以 上	科创 板打 新限售	28.03	49.84	165	4,62 4.95	8,22 3.60	-	
6885 73	信宇 人	2023- 08-09	6个 月以 上	科创 板打 新限售	23.68	28.80	285	6,74 8.80	8,20 8.00	-	
3014 89	思泉 新材	2023- 10-16	6个 月以 上	创业 板打 新限售	41.66	64.11	126	5,24 9.16	8,07 7.86	-	
3015 78	辰奕 智能	2023- 12-21	6个 月以 上	创业 板打 新限售	48.94	68.32	118	5,77 4.92	8,06 1.76	-	
3015 09	金凯 生科	2023- 07-26	6个 月以 上	创业 板打 新限售	56.56	62.23	122	6,90 0.32	7,59 2.06	-	
6886 03	天承 科技	2023- 06-30	6个 月以 上	科创 板打 新限售	55.00	74.14	101	5,55 5.00	7,48 8.14	-	

				售							
688671	碧兴物联	2023-08-02	6个月以上	科创板打新限售	36.12	34.30	213	7,693.56	7,305.90	-	
301555	惠柏新材	2023-10-24	6个月以上	创业板打新限售	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-	
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月以上	创业板打新限售	26.87	43.69	166	4,460.42	7,252.54	-	
301291	明阳电气	2023-06-21	6个月以上	创业板打新限售	38.13	28.36	255	9,723.15	7,231.80	-	
688610	埃科光电	2023-07-10	6个月以上	科创板打新限售	73.33	51.00	141	10,339.53	7,191.00	-	
301507	民生健康	2023-08-24	6个月以上	创业板打新限售	10.00	15.85	449	4,490.00	7,116.65	-	
301362	民爆光电	2023-07-27	6个月以上	创业板打新限售	51.05	38.52	184	9,393.20	7,087.68	-	
603296	华勤技术	2023-08-01	6个月以上	主板打新限售	80.80	77.75	91	7,352.80	7,075.25	-	
301533	威马	2023-08-07	6个	创业	29.50	33.16	206	6,077.00	6,830.96	-	

	农机		月以上	板打 新限售						
3012 61	恒工 精密	2023- 06-29	6个 月以 上	创业 板打 新限售	36.90	50.85	133	4,90 7.70	6,76 3.05	-
6886 51	盛邦 安全	2023- 07-19	6个 月以 上	科创 板打 新限售	39.90	46.05	146	5,82 5.40	6,72 3.30	-
6887 16	中研 股份	2023- 09-13	6个 月以 上	科创 板打 新限售	29.66	36.39	182	5,39 8.12	6,62 2.98	-
3014 98	乖宝 宠物	2023- 08-09	6个 月以 上	创业 板打 新限售	39.99	38.81	170	6,79 8.30	6,59 7.70	-
6886 48	中邮 科技	2023- 11-06	6个 月以 上	科创 板打 新限售	15.18	21.43	303	4,59 9.54	6,49 3.29	-
6887 02	盛科 通信	2023- 09-06	6个 月以 上	科创 板打 新限售	42.66	48.18	134	5,71 6.44	6,45 6.12	-
3012 51	威尔 高	2023- 08-30	6个 月以 上	创业 板打 新限售	28.88	34.59	183	5,28 5.04	6,32 9.97	-
3012 72	英华 特	2023- 07-06	6个 月以 上	创业 板打 新限售	51.39	53.38	118	6,06 4.02	6,29 8.84	-

				售							
301469	恒达新材	2023-08-10	6个月以上	创业板打新限售	36.58	33.09	189	6,913.62	6,254.01	-	
688719	爱科赛博	2023-09-20	6个月以上	科创板打新限售	69.98	60.10	104	7,277.92	6,250.40	-	
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月以上	创业板打新限售	57.88	45.48	136	7,871.68	6,185.28	-	
301329	信音电子	2023-07-05	6个月以上	创业板打新限售	21.00	22.23	278	5,838.00	6,179.94	-	
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6个月以上	主板打新限售	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-	
301518	长华化学	2023-07-26	6个月以上	创业板打新限售	25.75	23.01	259	6,669.25	5,959.59	-	
301505	苏州规划	2023-07-12	6个月以上	创业板打新限售	26.35	35.81	165	4,347.75	5,908.65	-	
301468	博盈特焊	2023-07-12	6个月以上	创业板打新限售	47.58	30.22	191	9,087.78	5,772.02	-	
001378	德冠	2023-10-23	6个	主板	31.68	31.27	184	5,829.12	5,753.68	-	

	新材		月以上	打新限售						
301519	舜禹股份	2023-07-19	6个月以上	创业板打新限售	20.93	20.21	283	5,923.19	5,719.43	-
688602	康鹏科技	2023-07-13	6个月以上	科创板打新限售	8.66	11.06	515	4,459.90	5,695.90	-
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月以上	创业板打新限售	37.56	43.57	130	4,882.80	5,664.10	-
601083	锦江航运	2023-11-28	6个月以上	主板打新限售	11.25	11.07	506	5,692.50	5,601.42	-
301393	昊帆生物	2023-07-05	6个月以上	创业板打新限售	67.68	59.37	93	6,294.24	5,521.41	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月以上	创业板打新限售	25.82	31.80	173	4,466.86	5,501.40	-
301528	多浦乐	2023-08-17	6个月以上	创业板打新限售	71.80	68.91	79	5,672.20	5,443.89	-
688693	锆威特	2023-08-10	6个月以上	科创板打新限售	40.83	43.41	122	4,981.26	5,296.02	-

301456	盘古智能	2023-07-06	6个月以上	创业板打新限售	37.96	30.39	174	6,605.04	5,287.86	-
301418	协昌科技	2023-08-10	6个月以上	创业板打新限售	51.88	50.20	104	5,395.52	5,220.80	-
301559	中集环科	2023-09-26	6个月以上	创业板打新限售	24.22	18.24	286	6,926.92	5,216.64	-
301525	儒竞科技	2023-08-23	6个月以上	创业板打新限售	99.57	81.46	62	6,173.34	5,050.52	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6个月以上	创业板打新限售	67.88	52.74	93	6,312.84	4,904.82	-
688646	逸飞激光	2023-07-21	6个月以上	科创板打新限售	46.80	36.07	135	6,318.00	4,869.45	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	6个月以上	科创板打新限售	103.40	78.23	62	6,410.80	4,850.26	-
001326	联域股份	2023-11-01	6个月以上	主板打新限售	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
301500	飞南资源	2023-09-13	6个月以	创业板打	23.97	20.89	216	5,177.52	4,512.24	-

			上	新限售						
301529	福赛科技	2023-08-31	6个月以上	创业板打新限售	36.60	37.88	118	4,318.80	4,469.84	-
301515	港通医疗	2023-07-13	6个月以上	创业板打新限售	31.16	28.27	155	4,829.80	4,381.85	-
001306	夏厦精密	2023-11-09	6个月以上	主板打新限售	53.63	75.36	56	3,003.28	4,220.16	-
688612	威迈斯	2023-07-19	6个月以上	科创板打新限售	47.29	37.97	110	5,201.90	4,176.70	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6个月以上	创业板打新限售	55.68	37.58	109	6,069.12	4,096.22	-
301548	崇德科技	2023-09-11	6个月以上	创业板打新限售	66.80	58.99	67	4,475.60	3,952.33	-
001239	永达股份	2023-12-04	6个月以上	主板打新限售	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6个月以上	主板打新限售	58.08	57.81	62	3,600.96	3,584.22	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6个月以	主板打新	14.23	18.19	196	2,789.08	3,565.24	-

			上	限售							
603273	天元智能	2023-10-16	6个月以上	主板打新限售	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-	
688450	光格科技	2023-07-17	6个月以上	科创板打新限售	53.09	36.42	92	4,884.28	3,350.64	-	
603270	金帝股份	2023-08-25	6个月以上	主板打新限售	21.77	29.58	104	2,264.08	3,076.32	-	
603373	安邦护卫	2023-12-13	6个月以上	主板打新限售	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-	
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6个月以上	主板打新限售	21.29	21.53	136	2,895.44	2,928.08	-	
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6个月以上	主板打新限售	15.32	23.87	119	1,823.08	2,840.53	-	
603193	润本股份	2023-10-09	6个月以上	主板打新限售	17.38	16.66	167	2,902.46	2,782.22	-	
603276	恒兴新材	2023-09-18	6个月以上	主板打新限售	25.73	24.88	106	2,727.38	2,637.28	-	
603275	众辰科技	2023-08-16	6个月以上	主板打新限售	49.97	39.70	64	3,198.08	2,540.80	-	
603075	热威股份	2023-09-01	6个月以上	主板打新限售	23.10	23.31	87	2,009.70	2,027.97	-	

注：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中需要限售的部分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

无。

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

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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(2022年12月31日：同)。

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2023年12月31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。

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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注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2023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0.17%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2023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410,128,311.52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 2023年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							

货币资金	25,777,441.76	-	-	-	-	-	25,777,441.76
结算备付金	62,902.36	-	-	-	-	-	62,902.36
交易性金融资产	-	-	21,133,283.01	-	-	363,820,709.45	384,953,992.46
应收申购款	-	-	-	-	-	107,801.79	107,801.79
资产总计	25,840,344.12	-	21,133,283.01	-	-	363,928,511.24	410,902,138.37
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	60,618.67	60,618.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	391,349.14	391,349.14
应付托管费	-	-	-	-	-	65,224.84	65,224.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-	72,634.77	72,634.77
其他负债	-	-	-	-	-	160,000.84	160,000.84
负债总计	-	-	-	-	-	749,828.26	749,828.26
利率敏感度缺口	25,840,344.12	-	21,133,283.01	-	-	363,178,682.98	410,152,310.11
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							
货币资金	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
其他负债	-	-	-	-	-	170,002.70	170,002.70
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

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2023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5.15%(2022年12月31日：4.74%)，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)。

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 2023年12月31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	363,820,709.45	88.70	228,791,036.55	92.40
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	363,820,709.45	88.70	228,791,036.55	92.40
----	----------------	-------	----------------	-------

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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	1.中证800指数收益率上升5%	15,464,320.24	11,221,571.87
	2.中证800指数收益率下降5%	-15,464,320.24	-11,221,571.87

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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	363,113,789.01	226,725,044.22
第二层次	21,133,283.01	11,728,771.64
第三层次	706,920.44	2,065,992.33
合计	384,953,992.46	240,519,808.19

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 2023年01月01日至2023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	-	2,065,992.33	2,065,992.33
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,093,379.58	1,093,379.58
转出第三层次	-	3,379,331.57	3,379,331.57
当期利得或损失总额	-	926,880.10	926,880.10
其中：计入损益的利得或损失	-	926,880.10	926,880.10
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	706,920.44	706,920.44
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	-	154,899.40	154,899.40
项目	上年度可比期间 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

注：1.于本报告期末，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。于本报告期，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	706,920.44	平均价格亚式期权模型	预期波动率	14.62%-21.9.88%	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	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
----------	--------------	------------	-------	--------------------	-----

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：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

无。

§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	363,820,709.45	88.54
	其中：股票	363,820,709.45	88.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,133,283.01	5.14
	其中：债券	21,133,283.01	5.14
	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	25,840,344.12	6.29
8	其他各项资产	107,801.79	0.03
9	合计	410,902,138.37	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	141,108.00	0.03
B	采矿业	3,252,814.00	0.79
C	制造业	281,922,137.39	68.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,353,044.00	4.23
E	建筑业	712,205.00	0.17
F	批发和零售业	6,193,501.71	1.51
G	交通运输、仓储和邮政业	14,188,781.42	3.46
H	住宿和餐饮业	2,320,606.00	0.57
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,429,214.15	3.52
J	金融业	9,220,600.10	2.25
K	房地产业	5,899,744.00	1.44
L	租赁和商务服务业	1,451,835.40	0.35
M	科学研究和技术服务业	780,645.39	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	5,280,993.89	1.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	429,528.00	0.10
S	综合	243,951.00	0.06
	合计	363,820,709.45	88.70

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	000338	潍柴动力	404,300	5,518,695.00	1.35
2	600519	贵州茅台	3,105	5,359,230.00	1.31
3	605288	凯迪股份	109,960	5,181,315.20	1.26
4	002393	力生制药	184,800	4,823,280.00	1.18
5	688571	杭华股份	640,200	4,788,696.00	1.17
6	002687	乔治白	790,900	4,215,497.00	1.03
7	603167	渤海轮渡	464,000	4,120,320.00	1.00
8	300851	交大思诺	130,100	4,055,217.00	0.99
9	300905	宝丽迪	209,100	4,052,358.00	0.99
10	002641	公元股份	804,900	4,048,647.00	0.99
11	600493	凤竹纺织	560,300	3,765,216.00	0.92
12	688129	东来技术	203,648	3,370,374.40	0.82
13	688687	凯因科技	85,287	2,973,104.82	0.72
14	300817	双飞集团	172,300	2,917,039.00	0.71
15	002098	浔兴股份	435,500	2,909,140.00	0.71
16	688067	爱威科技	120,624	2,872,057.44	0.70
17	600153	建发股份	287,600	2,769,588.00	0.68
18	002271	东方雨虹	140,000	2,688,000.00	0.66
19	600798	宁波海运	733,100	2,683,146.00	0.65
20	603080	新疆火炬	159,400	2,655,604.00	0.65
21	605169	洪通燃气	234,100	2,652,353.00	0.65
22	000973	佛塑科技	521,200	2,548,668.00	0.62
23	605208	永茂泰	263,200	2,500,400.00	0.61
24	300922	天秦装备	144,700	2,470,029.00	0.60
25	603048	浙江黎明	132,000	2,451,240.00	0.60
26	603283	赛腾股份	33,090	2,401,010.40	0.59
27	002415	海康威视	69,000	2,395,680.00	0.58

28	002879	长缆科技	149,300	2,391,786.00	0.58
29	600300	维维股份	759,800	2,362,978.00	0.58
30	605318	法狮龙	145,200	2,333,364.00	0.57
31	301045	天禄科技	85,000	2,312,000.00	0.56
32	002991	甘源食品	31,300	2,236,698.00	0.55
33	000959	首钢股份	645,700	2,234,122.00	0.54
34	600623	华谊集团	345,500	2,225,020.00	0.54
35	603992	松霖科技	122,200	2,216,708.00	0.54
36	002156	通富微电	91,700	2,120,104.00	0.52
37	601633	长城汽车	83,700	2,110,914.00	0.51
38	601985	中国核电	280,800	2,106,000.00	0.51
39	002791	坚朗五金	52,000	2,105,480.00	0.51
40	300566	激智科技	110,300	2,060,404.00	0.50
41	001207	联科科技	120,200	2,049,410.00	0.50
42	601018	宁波港	574,300	2,044,508.00	0.50
43	002472	双环传动	74,200	1,930,684.00	0.47
44	000157	中联重科	293,500	1,916,555.00	0.47
45	600979	广安爱众	547,900	1,895,734.00	0.46
46	603063	禾望电气	75,600	1,890,000.00	0.46
47	301149	隆华新材	152,300	1,883,951.00	0.46
48	600938	中国海油	88,200	1,849,554.00	0.45
49	600900	长江电力	77,100	1,799,514.00	0.44
50	000100	TCL科技	417,600	1,795,680.00	0.44
51	000589	贵州轮胎	292,700	1,791,324.00	0.44
52	688278	特宝生物	34,210	1,790,893.50	0.44
53	601288	农业银行	492,000	1,790,880.00	0.44
54	000333	美的集团	32,300	1,764,549.00	0.43
55	600312	平高电气	138,300	1,755,027.00	0.43
56	603486	科沃斯	41,900	1,736,336.00	0.42
57	300823	建科机械	80,700	1,735,857.00	0.42
58	002555	三七互娱	90,300	1,698,543.00	0.41

59	600019	宝钢股份	286,200	1,697,166.00	0.41
60	002367	康力电梯	224,200	1,685,984.00	0.41
61	002410	广联达	96,700	1,657,438.00	0.40
62	002159	三特索道	107,800	1,645,028.00	0.40
63	002557	洽洽食品	45,100	1,570,382.00	0.38
64	603225	新凤鸣	108,300	1,537,860.00	0.37
65	688332	中科蓝讯	20,373	1,536,531.66	0.37
66	301160	翔楼新材	36,300	1,532,949.00	0.37
67	603055	台华新材	127,300	1,532,692.00	0.37
68	000902	新洋丰	133,300	1,518,287.00	0.37
69	601500	通用股份	357,300	1,479,222.00	0.36
70	300626	华瑞股份	134,900	1,463,665.00	0.36
71	002753	永东股份	174,600	1,440,450.00	0.35
72	002493	荣盛石化	136,400	1,411,740.00	0.34
73	600258	首旅酒店	89,800	1,402,676.00	0.34
74	600612	老凤祥	20,100	1,386,900.00	0.34
75	688510	航亚科技	78,000	1,374,360.00	0.34
76	603617	君禾股份	146,700	1,349,640.00	0.33
77	601966	玲珑轮胎	69,800	1,342,254.00	0.33
78	605116	奥锐特	51,400	1,327,148.00	0.32
79	000631	顺发恒业	394,000	1,308,080.00	0.32
80	002827	高争民爆	77,800	1,303,150.00	0.32
81	300501	海顺新材	87,600	1,264,068.00	0.31
82	688127	蓝特光学	53,400	1,243,686.00	0.30
83	600038	中直股份	32,200	1,240,666.00	0.30
84	603282	亚光股份	47,600	1,229,984.00	0.30
85	688226	威腾电气	65,407	1,229,651.60	0.30
86	603111	康尼机电	219,800	1,224,286.00	0.30
87	600510	黑牡丹	215,800	1,219,270.00	0.30
88	301233	盛帮股份	27,400	1,217,108.00	0.30
89	301019	宁波色母	50,600	1,215,918.00	0.30

90	601021	春秋航空	24,200	1,214,840.00	0.30
91	603130	云中马	56,300	1,213,265.00	0.30
92	600637	东方明珠	160,400	1,206,208.00	0.29
93	000932	华菱钢铁	232,900	1,199,435.00	0.29
94	301301	川宁生物	142,000	1,192,800.00	0.29
95	300791	仙乐健康	34,200	1,185,372.00	0.29
96	301156	美农生物	62,500	1,178,750.00	0.29
97	600801	华新水泥	94,000	1,168,420.00	0.28
98	002158	汉钟精机	52,200	1,161,972.00	0.28
99	300122	智飞生物	19,000	1,161,090.00	0.28
100	300558	贝达药业	22,200	1,144,410.00	0.28
101	600674	川投能源	75,600	1,143,072.00	0.28
102	600094	大名城	380,000	1,140,000.00	0.28
103	001319	铭科精技	44,000	1,125,080.00	0.27
104	002381	双箭股份	145,800	1,105,164.00	0.27
105	603517	绝味食品	40,900	1,098,574.00	0.27
106	000921	海信家电	52,622	1,073,488.80	0.26
107	300124	汇川技术	16,800	1,060,752.00	0.26
108	000403	派林生物	38,700	1,054,188.00	0.26
109	688578	艾力斯	24,600	1,024,836.00	0.25
110	600182	S佳通	67,200	995,904.00	0.24
111	603558	健盛集团	99,700	966,093.00	0.24
112	300843	胜蓝股份	42,000	965,160.00	0.24
113	600398	海澜之家	125,100	928,242.00	0.23
114	301227	森鹰窗业	34,100	923,087.00	0.23
115	605338	巴比食品	42,900	921,492.00	0.22
116	600754	锦江酒店	30,700	917,930.00	0.22
117	300973	立高食品	18,700	907,885.00	0.22
118	002921	联诚精密	55,200	903,624.00	0.22
119	688169	石头科技	3,171	897,234.45	0.22
120	000568	泸州老窖	5,000	897,100.00	0.22

121	300286	安科瑞	34,400	891,992.00	0.22
122	002969	嘉美包装	215,300	887,036.00	0.22
123	601138	工业富联	57,800	873,936.00	0.21
124	002594	比亚迪	4,400	871,200.00	0.21
125	605128	上海沿浦	14,700	853,335.00	0.21
126	603683	晶华新材	74,500	838,870.00	0.20
127	000888	峨眉山 A	93,700	836,741.00	0.20
128	002138	顺络电子	30,900	834,609.00	0.20
129	002920	德赛西威	6,400	828,864.00	0.20
130	002452	长高电新	116,600	827,860.00	0.20
131	600160	巨化股份	49,200	811,308.00	0.20
132	300947	德必集团	51,500	808,035.00	0.20
133	688208	道通科技	33,800	802,750.00	0.20
134	601857	中国石油	112,000	790,720.00	0.19
135	002998	优彩资源	99,100	787,845.00	0.19
136	002709	天赐材料	31,300	785,004.00	0.19
137	301008	宏昌科技	26,000	784,940.00	0.19
138	601398	工商银行	162,900	778,662.00	0.19
139	000528	柳工	114,600	772,404.00	0.19
140	300438	鹏辉能源	27,300	772,317.00	0.19
141	002436	兴森科技	52,400	771,852.00	0.19
142	000548	湖南投资	141,400	770,630.00	0.19
143	601328	交通银行	133,300	765,142.00	0.19
144	300596	利安隆	25,800	762,648.00	0.19
145	603236	移远通信	14,160	761,100.00	0.19
146	600054	黄山旅游	69,200	752,896.00	0.18
147	601988	中国银行	186,100	742,539.00	0.18
148	603986	兆易创新	8,000	739,120.00	0.18
149	002011	盾安环境	53,600	737,000.00	0.18
150	002352	顺丰控股	18,200	735,280.00	0.18
151	300303	聚飞光电	121,600	721,088.00	0.18

152	002357	富临运业	95,500	721,025.00	0.18
153	301093	华兰股份	22,300	720,290.00	0.18
154	688065	凯赛生物	13,100	720,238.00	0.18
155	688689	银河微电	25,800	719,046.00	0.18
156	002080	中材科技	44,900	714,808.00	0.17
157	603379	三美股份	21,000	714,000.00	0.17
158	603348	文灿股份	18,300	710,040.00	0.17
159	601799	星宇股份	5,400	707,994.00	0.17
160	600998	九州通	100,900	707,309.00	0.17
161	600839	四川长虹	133,600	706,744.00	0.17
162	601688	华泰证券	50,400	703,080.00	0.17
163	601211	国泰君安	47,200	702,336.00	0.17
164	300755	华致酒行	38,300	700,507.00	0.17
165	688696	极米科技	6,200	700,476.00	0.17
166	600015	华夏银行	124,200	698,004.00	0.17
167	300898	熊猫乳品	28,800	695,808.00	0.17
168	300673	佩蒂股份	52,300	695,590.00	0.17
169	000039	中集集团	90,600	693,090.00	0.17
170	600011	华能国际	89,500	689,150.00	0.17
171	300441	鲍斯股份	99,700	686,933.00	0.17
172	600887	伊利股份	24,900	666,075.00	0.16
173	603045	福达合金	42,100	664,759.00	0.16
174	603916	苏博特	64,100	653,179.00	0.16
175	000035	中国天楹	131,400	649,116.00	0.16
176	300418	昆仑万维	17,300	647,020.00	0.16
177	000651	格力电器	19,600	630,532.00	0.15
178	601108	财通证券	80,800	627,008.00	0.15
179	002358	森源电气	142,700	620,745.00	0.15
180	603829	洛凯股份	37,500	612,375.00	0.15
181	688002	睿创微纳	13,600	601,392.00	0.15
182	002133	广宇集团	171,800	599,582.00	0.15

183	002206	海利得	119,000	597,380.00	0.15
184	002730	电光科技	62,900	596,292.00	0.15
185	603288	海天味业	15,700	595,815.00	0.15
186	600531	豫光金铅	97,700	591,085.00	0.14
187	002938	鹏鼎控股	26,400	589,248.00	0.14
188	300201	海伦哲	116,500	587,160.00	0.14
189	002283	天润工业	100,159	585,930.15	0.14
190	688475	萤石网络	13,000	583,700.00	0.14
191	603579	荣泰健康	27,900	581,157.00	0.14
192	002774	快意电梯	69,800	579,340.00	0.14
193	300308	中际旭创	5,100	575,841.00	0.14
194	600600	青岛啤酒	7,700	575,575.00	0.14
195	688036	传音控股	4,149	574,221.60	0.14
196	002763	汇洁股份	68,200	573,562.00	0.14
197	600479	千金药业	52,600	566,502.00	0.14
198	601368	绿城水务	105,500	564,425.00	0.14
199	300682	朗新集团	34,400	563,816.00	0.14
200	300936	中英科技	13,200	562,716.00	0.14
201	603078	江化微	35,100	562,302.00	0.14
202	300638	广和通	29,500	561,385.00	0.14
203	002752	昇兴股份	106,500	551,670.00	0.13
204	601006	大秦铁路	76,400	550,844.00	0.13
205	600276	恒瑞医药	11,900	538,237.00	0.13
206	000977	浪潮信息	16,100	534,520.00	0.13
207	605158	华达新材	70,200	533,520.00	0.13
208	600741	华域汽车	32,400	527,472.00	0.13
209	002449	国星光电	55,200	522,744.00	0.13
210	688503	聚和材料	9,600	514,560.00	0.13
211	601567	三星医疗	24,900	510,450.00	0.12
212	603611	诺力股份	26,500	501,645.00	0.12
213	603530	神马电力	24,100	499,834.00	0.12

214	601186	中国铁建	65,300	496,933.00	0.12
215	601218	吉鑫科技	123,400	493,600.00	0.12
216	002073	软控股份	75,100	493,407.00	0.12
217	002580	圣阳股份	56,700	491,589.00	0.12
218	001979	招商蛇口	50,800	484,124.00	0.12
219	605177	东亚药业	18,100	479,288.00	0.12
220	002479	富春环保	99,700	475,569.00	0.12
221	600101	明星电力	56,300	473,483.00	0.12
222	300496	中科创达	5,900	472,354.00	0.12
223	600025	华能水电	54,700	472,061.00	0.12
224	002045	国光电器	28,300	471,195.00	0.11
225	600201	生物股份	43,300	466,341.00	0.11
226	605376	博迁新材	16,400	462,480.00	0.11
227	688049	炬芯科技	12,000	456,840.00	0.11
228	300888	稳健医疗	12,100	450,725.00	0.11
229	001209	洪兴股份	25,100	449,541.00	0.11
230	603298	杭叉集团	18,000	447,840.00	0.11
231	300687	赛意信息	19,800	431,244.00	0.11
232	600854	春兰股份	81,100	427,397.00	0.10
233	002611	东方精工	85,600	424,576.00	0.10
234	600023	浙能电力	91,800	423,198.00	0.10
235	600161	天坛生物	13,400	414,596.00	0.10
236	300217	东方电热	76,300	410,494.00	0.10
237	300194	福安药业	93,333	408,798.54	0.10
238	003038	鑫铂股份	11,900	408,765.00	0.10
239	000858	五粮液	2,903	407,319.93	0.10
240	002517	恺英网络	36,400	406,588.00	0.10
241	603507	振江股份	15,600	404,196.00	0.10
242	300563	神宇股份	24,900	398,151.00	0.10
243	600595	中孚实业	113,200	393,936.00	0.10
244	002521	齐峰新材	47,500	392,825.00	0.10

245	603056	德邦股份	27,100	392,137.00	0.10
246	600436	片仔癀	1,600	387,184.00	0.09
247	002196	方正电机	53,500	384,130.00	0.09
248	003003	天元股份	33,400	383,766.00	0.09
249	301127	天源环保	34,900	383,551.00	0.09
250	601058	赛轮轮胎	32,600	383,050.00	0.09
251	601996	丰林集团	132,700	378,195.00	0.09
252	601163	三角轮胎	26,200	377,542.00	0.09
253	300274	阳光电源	4,300	376,637.00	0.09
254	603365	水星家纺	26,100	375,318.00	0.09
255	002103	广博股份	46,800	374,868.00	0.09
256	301004	嘉益股份	8,200	372,690.00	0.09
257	003002	壶化股份	24,500	372,155.00	0.09
258	002623	亚玛顿	13,900	371,825.00	0.09
259	000895	双汇发展	13,900	371,269.00	0.09
260	600859	王府井	23,200	370,504.00	0.09
261	603099	长白山	24,700	370,006.00	0.09
262	300009	安科生物	35,900	366,898.00	0.09
263	300701	森霸传感	31,900	366,212.00	0.09
264	000533	顺钠股份	77,900	365,351.00	0.09
265	600613	神奇制药	47,900	364,519.00	0.09
266	300920	润阳科技	17,200	362,060.00	0.09
267	603737	三棵树	7,600	361,836.00	0.09
268	601555	东吴证券	49,200	359,652.00	0.09
269	002296	辉煌科技	43,500	358,875.00	0.09
270	688147	微导纳米	9,200	358,708.00	0.09
271	300105	龙源技术	52,800	358,512.00	0.09
272	688083	中望软件	3,600	358,344.00	0.09
273	000531	穗恒运 A	53,500	357,915.00	0.09
274	001296	长江材料	15,067	354,526.51	0.09
275	600570	恒生电子	12,300	353,748.00	0.09

276	002831	裕同科技	12,800	352,128.00	0.09
277	300430	诚益通	24,500	350,105.00	0.09
278	301042	安联锐视	8,900	348,880.00	0.09
279	002429	兆驰股份	62,300	347,634.00	0.08
280	688007	光峰科技	13,400	346,792.00	0.08
281	002462	嘉事堂	24,300	345,303.00	0.08
282	000690	宝新能源	77,900	345,097.00	0.08
283	603198	迎驾贡酒	5,200	344,708.00	0.08
284	601318	中国平安	8,497	342,429.10	0.08
285	605167	利柏特	35,800	339,742.00	0.08
286	000404	长虹华意	55,600	327,484.00	0.08
287	002444	巨星科技	14,300	322,036.00	0.08
288	301026	浩通科技	10,500	319,725.00	0.08
289	300221	银禧科技	52,800	316,800.00	0.08
290	300625	三雄极光	21,300	315,666.00	0.08
291	600469	风神股份	51,000	314,670.00	0.08
292	300872	天阳科技	23,000	314,640.00	0.08
293	603165	荣晟环保	26,200	313,876.00	0.08
294	301526	国际复材	57,516	311,851.32	0.08
295	603950	长源东谷	20,200	311,080.00	0.08
296	300541	先进数通	20,200	310,878.00	0.08
297	605499	东鹏饮料	1,700	310,267.00	0.08
298	002869	金溢科技	15,300	309,672.00	0.08
299	600644	乐山电力	44,300	308,328.00	0.08
300	600176	中国巨石	31,200	306,696.00	0.07
301	600382	广东明珠	67,200	303,744.00	0.07
302	603090	宏盛股份	12,800	301,056.00	0.07
303	301257	普蕊斯	4,700	298,450.00	0.07
304	002032	苏泊尔	5,600	296,856.00	0.07
305	002273	水晶光电	21,500	291,110.00	0.07
306	300376	易事特	45,700	291,109.00	0.07

307	600737	中粮糖业	35,200	290,048.00	0.07
308	601088	中国神华	9,100	285,285.00	0.07
309	600977	中国电影	23,300	285,192.00	0.07
310	601919	中远海控	29,600	283,568.00	0.07
311	688772	珠海冠宇	12,800	281,728.00	0.07
312	002215	诺普信	34,100	281,666.00	0.07
313	301085	亚康股份	4,900	281,309.00	0.07
314	601137	博威合金	18,100	281,093.00	0.07
315	300857	协创数据	5,300	280,847.00	0.07
316	002563	森马服饰	48,200	278,114.00	0.07
317	600325	华发股份	38,500	277,585.00	0.07
318	688187	时代电气	7,600	276,108.00	0.07
319	002016	世荣兆业	43,800	275,502.00	0.07
320	688300	联瑞新材	5,200	275,340.00	0.07
321	601939	建设银行	42,100	274,071.00	0.07
322	002681	奋达科技	54,100	267,795.00	0.07
323	603689	皖天然气	30,700	266,783.00	0.07
324	600958	东方证券	30,600	266,220.00	0.06
325	002615	哈尔斯	36,200	265,346.00	0.06
326	001230	劲旅环境	11,300	265,098.00	0.06
327	002443	金洲管道	38,100	260,985.00	0.06
328	002724	海洋王	31,500	258,930.00	0.06
329	601169	北京银行	56,900	257,757.00	0.06
330	601609	金田股份	37,500	253,875.00	0.06
331	002646	天佑德酒	18,600	253,146.00	0.06
332	002627	三峡旅游	47,200	252,048.00	0.06
333	605066	天正电气	27,200	249,696.00	0.06
334	600183	生益科技	13,600	249,016.00	0.06
335	002540	亚太科技	37,400	247,214.00	0.06
336	300394	天孚通信	2,700	247,104.00	0.06
337	300790	宇瞳光学	15,100	245,677.00	0.06

338	000551	创元科技	23,300	243,951.00	0.06
339	601158	重庆水务	42,600	241,542.00	0.06
340	605258	协和电子	8,600	238,822.00	0.06
341	600050	中国联通	53,700	235,206.00	0.06
342	605555	德昌股份	10,100	230,785.00	0.06
343	002732	燕塘乳业	12,000	230,400.00	0.06
344	600380	健康元	18,400	228,712.00	0.06
345	002384	东山精密	12,500	227,250.00	0.06
346	688466	金科环境	12,800	227,200.00	0.06
347	002469	三维化学	36,900	223,614.00	0.05
348	603596	伯特利	3,200	221,760.00	0.05
349	002896	中大力德	6,100	221,735.00	0.05
350	002891	中宠股份	8,400	221,340.00	0.05
351	300748	金力永磁	10,900	220,398.00	0.05
352	002035	华帝股份	35,300	219,213.00	0.05
353	603605	珀莱雅	2,200	218,680.00	0.05
354	603817	海峡环保	34,100	217,558.00	0.05
355	600779	水井坊	3,700	217,449.00	0.05
356	688489	三未信安	4,600	216,292.00	0.05
357	300679	电连技术	5,200	215,800.00	0.05
358	000729	燕京啤酒	25,000	215,750.00	0.05
359	601390	中国中铁	37,900	215,272.00	0.05
360	603989	艾华集团	10,000	215,200.00	0.05
361	688088	虹软科技	5,200	213,408.00	0.05
362	002533	金杯电工	26,000	210,080.00	0.05
363	688616	西力科技	15,400	210,056.00	0.05
364	002823	凯中精密	16,500	209,550.00	0.05
365	002733	雄韬股份	13,900	209,056.00	0.05
366	600745	闻泰科技	4,900	207,319.00	0.05
367	002372	伟星新材	14,200	205,474.00	0.05
368	600789	鲁抗医药	28,600	204,204.00	0.05

369	000938	紫光股份	10,500	203,175.00	0.05
370	603323	苏农银行	48,800	203,008.00	0.05
371	002807	江阴银行	57,100	202,705.00	0.05
372	603367	辰欣药业	13,800	202,032.00	0.05
373	300014	亿纬锂能	4,700	198,340.00	0.05
374	002371	北方华创	800	196,568.00	0.05
375	603893	瑞芯微	3,100	196,540.00	0.05
376	000926	福星股份	47,000	195,990.00	0.05
377	600327	大东方	37,900	190,258.00	0.05
378	600216	浙江医药	17,700	189,921.00	0.05
379	603297	永新光学	1,900	188,765.00	0.05
380	002171	楚江新材	25,200	188,496.00	0.05
381	600351	亚宝药业	27,300	188,370.00	0.05
382	002142	宁波银行	9,300	187,023.00	0.05
383	300360	炬华科技	13,600	185,776.00	0.05
384	300304	云意电气	27,200	184,688.00	0.05
385	600809	山西汾酒	800	184,584.00	0.05
386	002820	桂发祥	16,100	183,862.00	0.04
387	002212	天融信	18,500	180,930.00	0.04
388	300894	火星人	11,100	180,264.00	0.04
389	000063	中兴通讯	6,800	180,064.00	0.04
390	300348	长亮科技	17,300	178,363.00	0.04
391	002566	益盛药业	20,000	178,200.00	0.04
392	002917	金奥博	18,000	177,660.00	0.04
393	002766	索菱股份	32,400	176,580.00	0.04
394	600235	民丰特纸	28,700	176,218.00	0.04
395	300534	陇神戎发	17,600	173,712.00	0.04
396	603029	天鹅股份	8,500	173,400.00	0.04
397	600036	招商银行	6,200	172,484.00	0.04
398	600150	中国船舶	5,800	170,752.00	0.04
399	300996	普联软件	7,400	169,460.00	0.04

400	002705	新宝股份	11,600	169,012.00	0.04
401	688155	先惠技术	3,000	166,890.00	0.04
402	603688	石英股份	1,900	165,072.00	0.04
403	601898	中煤能源	16,900	163,761.00	0.04
404	600028	中国石化	29,300	163,494.00	0.04
405	603192	汇得科技	8,300	163,095.00	0.04
406	301566	达利凯普	5,755	162,891.85	0.04
407	301041	金百泽	6,000	162,120.00	0.04
408	002835	同为股份	8,800	157,872.00	0.04
409	600099	林海股份	15,400	157,388.00	0.04
410	301359	东南电子	5,900	156,999.00	0.04
411	600346	恒力石化	11,900	156,723.00	0.04
412	688033	天宜上佳	9,200	155,480.00	0.04
413	600989	宝丰能源	10,500	155,085.00	0.04
414	300088	长信科技	23,100	154,539.00	0.04
415	000708	中信特钢	11,000	154,440.00	0.04
416	300310	宜通世纪	34,900	154,258.00	0.04
417	002064	华峰化学	22,900	153,659.00	0.04
418	000951	中国重汽	11,500	153,640.00	0.04
419	600535	天士力	9,000	153,180.00	0.04
420	600383	金地集团	34,700	151,292.00	0.04
421	601096	宏盛华源	27,721	150,967.18	0.04
422	002558	巨人网络	13,500	150,390.00	0.04
423	002625	光启技术	10,100	149,278.00	0.04
424	002066	瑞泰科技	13,400	148,874.00	0.04
425	300882	万胜智能	6,100	148,596.00	0.04
426	603590	康辰药业	3,900	148,512.00	0.04
427	000550	江铃汽车	7,800	148,434.00	0.04
428	603093	南华期货	12,300	147,600.00	0.04
429	300350	华鹏飞	28,600	146,718.00	0.04
430	002662	京威股份	41,500	145,665.00	0.04

431	600386	北巴传媒	32,500	145,600.00	0.04
432	002648	卫星化学	9,800	144,550.00	0.04
433	601999	出版传媒	19,400	144,336.00	0.04
434	600166	福田汽车	52,600	143,598.00	0.04
435	688310	迈得医疗	4,800	143,520.00	0.03
436	000737	北方铜业	24,600	142,680.00	0.03
437	002107	沃华医药	23,500	142,645.00	0.03
438	000777	中核科技	9,800	142,492.00	0.03
439	600794	保税科技	34,900	142,392.00	0.03
440	601100	恒立液压	2,600	142,168.00	0.03
441	600282	南钢股份	38,400	142,080.00	0.03
442	600097	开创国际	13,200	141,108.00	0.03
443	600236	桂冠电力	25,300	140,162.00	0.03
444	688626	翔宇医疗	2,600	138,554.00	0.03
445	600292	远达环保	22,600	137,182.00	0.03
446	600368	五洲交通	34,600	136,670.00	0.03
447	603008	喜临门	8,000	136,080.00	0.03
448	002120	韵达股份	18,200	135,772.00	0.03
449	600690	海尔智家	6,400	134,400.00	0.03
450	600007	中国国贸	6,900	133,722.00	0.03
451	600760	中航沈飞	3,100	130,758.00	0.03
452	600573	惠泉啤酒	12,500	129,750.00	0.03
453	600941	中国移动	1,300	129,324.00	0.03
454	603076	乐惠国际	4,800	128,640.00	0.03
455	600602	云赛智联	11,100	128,427.00	0.03
456	300207	欣旺达	8,700	128,412.00	0.03
457	600438	通威股份	5,100	127,653.00	0.03
458	300022	吉峰科技	25,700	126,701.00	0.03
459	688076	诺泰生物	2,800	125,860.00	0.03
460	605580	恒盛能源	10,800	125,496.00	0.03
461	002126	银轮股份	6,700	125,089.00	0.03

462	300866	安克创新	1,400	124,040.00	0.03
463	300840	酷特智能	6,100	121,451.00	0.03
464	301235	华康医疗	4,700	120,461.00	0.03
465	002003	伟星股份	11,100	120,435.00	0.03
466	300462	华铭智能	10,200	120,258.00	0.03
467	688789	宏华数科	1,200	119,892.00	0.03
468	603258	电魂网络	5,200	119,496.00	0.03
469	301413	安培龙	1,633	118,542.96	0.03
470	603027	千禾味业	7,300	118,041.00	0.03
471	600888	新疆众和	16,300	118,012.00	0.03
472	600180	瑞茂通	19,300	117,537.00	0.03
473	688008	澜起科技	2,000	117,520.00	0.03
474	600113	浙江东日	14,200	116,724.00	0.03
475	600309	万华化学	1,500	115,230.00	0.03
476	603569	长久物流	9,300	115,227.00	0.03
477	600529	山东药玻	4,500	115,200.00	0.03
478	600223	福瑞达	11,900	114,597.00	0.03
479	603786	科博达	1,600	114,176.00	0.03
480	300783	三只松鼠	6,300	113,715.00	0.03
481	603650	彤程新材	3,400	113,220.00	0.03
482	300782	卓胜微	800	112,800.00	0.03
483	603039	泛微网络	2,400	112,560.00	0.03
484	301459	丰茂股份	2,077	95,083.08	0.02
485	301578	辰奕智能	1,175	89,662.16	0.02
486	688716	中研股份	1,814	71,086.98	0.02
487	603004	鼎龙科技	1,948	69,190.05	0.02
488	301500	飞南资源	2,153	46,487.03	0.01
489	001239	永达股份	1,887	44,228.22	0.01
490	301548	崇德科技	661	40,239.79	0.01
491	603373	安邦护卫	876	36,981.40	0.01
492	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01

493	603231	索宝蛋白	1,357	31,646.00	0.01
494	301348	蓝箭电子	377	16,802.89	0.00
495	300904	威力传动	264	16,243.92	0.00
496	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
497	688652	京仪装备	253	13,219.25	0.00
498	301421	波长光电	216	12,823.92	0.00
499	301558	三态股份	869	11,644.60	0.00
500	688629	华丰科技	527	11,541.30	0.00
501	301488	豪恩汽电	165	11,399.85	0.00
502	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
503	301172	君逸数码	292	11,142.72	0.00
504	688627	精智达	124	10,877.28	0.00
505	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
506	688592	司南导航	200	10,106.00	0.00
507	688548	广钢气体	783	9,983.25	0.00
508	301370	国科恒泰	611	9,782.11	0.00
509	688549	中巨芯	1,172	9,481.48	0.00
510	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
511	301499	维科精密	314	9,084.02	0.00
512	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
513	688582	芯动联科	219	8,468.73	0.00
514	301372	科净源	194	8,456.46	0.00
515	688563	航材股份	137	8,287.13	0.00
516	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
517	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
518	301489	思泉新材	126	8,077.86	0.00
519	301509	金凯生科	122	7,592.06	0.00
520	688603	天承科技	101	7,488.14	0.00
521	688671	碧兴物联	213	7,305.90	0.00
522	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
523	301517	陕西华达	166	7,252.54	0.00

524	301291	明阳电气	255	7,231.80	0.00
525	688610	埃科光电	141	7,191.00	0.00
526	301507	民生健康	449	7,116.65	0.00
527	301362	民爆光电	184	7,087.68	0.00
528	603296	华勤技术	91	7,075.25	0.00
529	688620	安凯微	582	6,879.24	0.00
530	301533	威马农机	206	6,830.96	0.00
531	301261	恒工精密	133	6,763.05	0.00
532	688651	盛邦安全	146	6,723.30	0.00
533	301498	乖宝宠物	170	6,597.70	0.00
534	301295	美硕科技	198	6,571.62	0.00
535	301397	溯联股份	144	6,505.92	0.00
536	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
537	688702	盛科通信	134	6,456.12	0.00
538	301251	威尔高	183	6,329.97	0.00
539	301272	英华特	118	6,298.84	0.00
540	301469	恒达新材	189	6,254.01	0.00
541	688719	爱科赛博	104	6,250.40	0.00
542	301210	金杨股份	136	6,185.28	0.00
543	301329	信音电子	278	6,179.94	0.00
544	301518	长华化学	259	5,959.59	0.00
545	301505	苏州规划	165	5,908.65	0.00
546	301468	博盈特焊	191	5,772.02	0.00
547	001378	德冠新材	184	5,753.68	0.00
548	301519	舜禹股份	283	5,719.43	0.00
549	688602	康鹏科技	515	5,695.90	0.00
550	301550	斯菱股份	130	5,664.10	0.00
551	601083	锦江航运	506	5,601.42	0.00
552	301393	昊帆生物	93	5,521.41	0.00
553	301202	朗威股份	173	5,501.40	0.00
554	688631	莱斯信息	155	5,463.75	0.00

555	301528	多浦乐	79	5,443.89	0.00
556	688693	锆威特	122	5,296.02	0.00
557	301456	盘古智能	174	5,287.86	0.00
558	301418	协昌科技	104	5,220.80	0.00
559	301559	中集环科	286	5,216.64	0.00
560	301525	儒竞科技	62	5,050.52	0.00
561	301520	万邦医药	93	4,904.82	0.00
562	688646	逸飞激光	135	4,869.45	0.00
563	688657	浩辰软件	62	4,850.26	0.00
564	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
565	688429	时创能源	213	4,513.47	0.00
566	301170	锡南科技	147	4,473.21	0.00
567	301529	福赛科技	118	4,469.84	0.00
568	301515	港通医疗	155	4,381.85	0.00
569	001306	夏厦精密	56	4,220.16	0.00
570	688612	威迈斯	110	4,176.70	0.00
571	301371	敷尔佳	109	4,096.22	0.00
572	603062	麦加芯彩	62	3,584.22	0.00
573	603107	上海汽配	196	3,565.24	0.00
574	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
575	688450	光格科技	92	3,350.64	0.00
576	603270	金帝股份	104	3,076.32	0.00
577	603119	浙江荣泰	119	2,840.53	0.00
578	603193	润本股份	167	2,782.22	0.00
579	603276	恒兴新材	106	2,637.28	0.00
580	603275	众辰科技	64	2,540.80	0.00
581	603075	热威股份	87	2,027.97	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	300308	中际旭创	23,161,122.34	9.35
2	000333	美的集团	19,992,293.44	8.07
3	000651	格力电器	17,521,881.00	7.08
4	600519	贵州茅台	17,252,172.00	6.97
5	002594	比亚迪	16,771,383.00	6.77
6	300750	宁德时代	14,358,414.00	5.80
7	601318	中国平安	14,153,003.00	5.72
8	601888	中国中免	13,900,872.00	5.61
9	000338	潍柴动力	13,594,593.00	5.49
10	601688	华泰证券	13,229,094.00	5.34
11	600030	中信证券	13,130,977.00	5.30
12	300274	阳光电源	12,967,217.00	5.24
13	000568	泸州老窖	12,574,857.00	5.08
14	601668	中国建筑	12,541,073.00	5.06
15	002027	分众传媒	12,301,646.00	4.97
16	000063	中兴通讯	12,035,399.84	4.86
17	600036	招商银行	11,963,820.00	4.83
18	000921	海信家电	11,547,353.30	4.66
19	600887	伊利股份	11,467,821.00	4.63
20	600570	恒生电子	11,315,240.00	4.57
21	002459	晶澳科技	11,208,789.20	4.53
22	002271	东方雨虹	11,048,619.00	4.46
23	002299	圣农发展	10,950,028.00	4.42
24	601869	长飞光纤	10,774,134.00	4.35
25	688390	固德威	10,498,748.53	4.24
26	688599	天合光能	10,408,117.12	4.20
27	600060	海信视像	10,349,135.00	4.18
28	601567	三星医疗	10,303,299.00	4.16

29	000858	五粮液	10,263,081.00	4.14
30	601012	隆基绿能	10,164,181.49	4.10
31	300413	芒果超媒	10,083,290.00	4.07
32	002352	顺丰控股	9,928,356.00	4.01
33	601816	京沪高铁	9,792,920.00	3.95
34	002371	北方华创	9,600,131.00	3.88
35	600483	福能股份	9,562,249.00	3.86
36	600008	首创环保	9,419,220.00	3.80
37	688063	派能科技	9,365,199.14	3.78
38	603609	禾丰股份	9,355,793.00	3.78
39	002372	伟星新材	9,336,713.00	3.77
40	600633	浙数文化	9,105,942.20	3.68
41	605288	凯迪股份	8,911,216.20	3.60
42	603298	杭叉集团	8,884,271.06	3.59
43	002603	以岭药业	8,572,490.00	3.46
44	601100	恒立液压	8,502,796.00	3.43
45	603345	安井食品	8,446,915.40	3.41
46	600809	山西汾酒	8,393,291.00	3.39
47	688223	晶科能源	8,365,601.58	3.38
48	000596	古井贡酒	8,348,584.66	3.37
49	002641	公元股份	8,123,103.00	3.28
50	605499	东鹏饮料	8,105,902.00	3.27
51	603688	石英股份	8,060,671.12	3.26
52	601138	工业富联	8,020,948.00	3.24
53	000157	中联重科	8,002,492.00	3.23
54	688777	中控技术	7,976,693.34	3.22
55	600642	申能股份	7,727,914.00	3.12
56	688687	凯因科技	7,698,321.42	3.11
57	300751	迈为股份	7,566,228.80	3.06
58	600153	建发股份	7,499,663.00	3.03
59	601857	中国石油	7,397,203.00	2.99

60	000938	紫光股份	7,279,615.60	2.94
61	002056	横店东磁	7,168,985.00	2.90
62	600276	恒瑞医药	7,112,739.00	2.87
63	002600	领益智造	7,079,834.00	2.86
64	600312	平高电气	7,063,437.00	2.85
65	002393	力生制药	7,046,608.00	2.85
66	300033	同花顺	7,045,126.00	2.85
67	600566	济川药业	6,791,575.00	2.74
68	600958	东方证券	6,781,871.88	2.74
69	300866	安克创新	6,749,308.00	2.73
70	300905	宝丽迪	6,736,400.00	2.72
71	002139	拓邦股份	6,672,127.00	2.69
72	000001	平安银行	6,664,074.80	2.69
73	002179	中航光电	6,630,798.00	2.68
74	600919	江苏银行	6,467,179.00	2.61
75	688126	沪硅产业	6,450,474.85	2.61
76	688571	杭华股份	6,429,563.69	2.60
77	600098	广州发展	6,411,792.00	2.59
78	002687	乔治白	6,401,105.00	2.59
79	003012	东鹏控股	6,353,215.44	2.57
80	002410	广联达	6,346,351.00	2.56
81	002568	百润股份	6,324,828.00	2.55
82	300638	广和通	6,319,068.52	2.55
83	600795	国电电力	6,309,633.00	2.55
84	605117	德业股份	6,297,197.00	2.54
85	600837	海通证券	6,220,906.00	2.51
86	300017	网宿科技	6,169,333.63	2.49
87	600031	三一重工	6,118,113.00	2.47
88	600583	海油工程	6,090,605.00	2.46
89	002142	宁波银行	6,002,461.94	2.42
90	600028	中国石化	5,975,354.00	2.41

91	002080	中材科技	5,974,085.00	2.41
92	600372	中航机载	5,929,323.50	2.39
93	601601	中国太保	5,892,833.00	2.38
94	002475	立讯精密	5,829,405.82	2.35
95	600011	华能国际	5,799,411.00	2.34
96	002236	大华股份	5,726,764.73	2.31
97	601211	国泰君安	5,711,469.00	2.31
98	603338	浙江鼎力	5,657,382.00	2.28
99	603167	渤海轮渡	5,620,194.00	2.27
100	600420	国药现代	5,608,360.00	2.27
101	603127	昭衍新药	5,536,504.00	2.24
102	603027	千禾味业	5,531,768.08	2.23
103	600803	新奥股份	5,521,457.00	2.23
104	600557	康缘药业	5,503,638.81	2.22
105	002612	朗姿股份	5,497,667.00	2.22
106	600493	凤竹纺织	5,465,098.00	2.21
107	600438	通威股份	5,460,421.00	2.21
108	601669	中国电建	5,460,398.00	2.21
109	601137	博威合金	5,456,411.00	2.20
110	600066	宇通客车	5,452,511.58	2.20
111	002966	苏州银行	5,421,411.20	2.19
112	600233	圆通速递	5,411,678.00	2.19
113	002273	水晶光电	5,397,081.00	2.18
114	601128	常熟银行	5,377,248.00	2.17
115	300851	交大思诺	5,368,834.00	2.17
116	601958	金钼股份	5,363,593.00	2.17
117	601658	邮储银行	5,267,389.00	2.13
118	300454	深信服	5,225,356.94	2.11
119	002555	三七互娱	5,208,506.63	2.10
120	002353	杰瑞股份	5,200,196.00	2.10
121	601916	浙商银行	5,165,115.00	2.09

122	000403	派林生物	5,147,272.00	2.08
123	605108	同庆楼	5,128,198.00	2.07
124	002230	科大讯飞	5,047,687.00	2.04
125	603444	吉比特	5,012,916.20	2.02
126	688036	传音控股	5,004,684.35	2.02
127	002060	粤水电	4,994,467.00	2.02
128	002448	中原内配	4,983,015.00	2.01
129	300898	熊猫乳品	4,981,619.00	2.01
130	601966	玲珑轮胎	4,964,536.00	2.00

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 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	28,244,943.00	11.41
2	300308	中际旭创	25,800,371.00	10.42
3	000651	格力电器	22,372,380.00	9.04
4	601318	中国平安	19,556,288.00	7.90
5	002594	比亚迪	18,944,434.00	7.65
6	000333	美的集团	18,367,172.80	7.42
7	300750	宁德时代	17,441,803.86	7.04
8	600036	招商银行	16,030,828.62	6.47
9	000921	海信家电	14,974,506.00	6.05
10	601668	中国建筑	14,733,133.00	5.95
11	300274	阳光电源	14,434,666.46	5.83
12	601888	中国中免	14,398,536.48	5.82
13	600030	中信证券	14,224,891.20	5.74
14	002299	圣农发展	13,733,115.00	5.55

15	000568	泸州老窖	12,852,135.32	5.19
16	601688	华泰证券	12,778,030.00	5.16
17	601012	隆基绿能	12,583,851.40	5.08
18	600060	海信视像	12,446,846.00	5.03
19	603609	禾丰股份	12,223,918.06	4.94
20	000063	中兴通讯	11,866,606.06	4.79
21	002027	分众传媒	11,716,770.00	4.73
22	601567	三星医疗	11,482,056.00	4.64
23	002371	北方华创	11,307,394.00	4.57
24	600008	首创环保	10,879,187.00	4.39
25	601869	长飞光纤	10,870,805.00	4.39
26	000858	五粮液	10,836,340.00	4.38
27	600570	恒生电子	10,817,298.40	4.37
28	002459	晶澳科技	10,653,227.75	4.30
29	600887	伊利股份	10,522,172.00	4.25
30	600809	山西汾酒	10,245,132.00	4.14
31	688063	派能科技	10,231,636.46	4.13
32	688390	固德威	10,200,064.95	4.12
33	300413	芒果超媒	10,163,933.00	4.10
34	688599	天合光能	9,976,818.12	4.03
35	000596	古井贡酒	9,913,989.00	4.00
36	601816	京沪高铁	9,843,484.16	3.98
37	600483	福能股份	9,732,695.00	3.93
38	600633	浙数文化	9,416,696.88	3.80
39	000338	潍柴动力	9,017,312.00	3.64
40	002372	伟星新材	8,906,256.00	3.60
41	603298	杭叉集团	8,795,392.35	3.55
42	002352	顺丰控股	8,668,113.76	3.50
43	002603	以岭药业	8,380,796.00	3.38
44	601100	恒立液压	8,301,568.00	3.35
45	688223	晶科能源	8,283,910.31	3.35

46	002271	东方雨虹	8,276,561.00	3.34
47	300502	新易盛	8,273,777.00	3.34
48	600795	国电电力	8,126,138.00	3.28
49	300017	网宿科技	8,006,826.42	3.23
50	603345	安井食品	7,989,162.13	3.23
51	002139	拓邦股份	7,865,063.00	3.18
52	600642	申能股份	7,863,795.00	3.18
53	688777	中控技术	7,860,191.45	3.17
54	603688	石英股份	7,699,262.00	3.11
55	601857	中国石油	7,698,222.00	3.11
56	605117	德业股份	7,544,986.52	3.05
57	300033	同花顺	7,541,797.04	3.05
58	605499	东鹏饮料	7,423,055.00	3.00
59	002600	领益智造	7,319,436.00	2.96
60	000938	紫光股份	7,310,030.00	2.95
61	600732	爱旭股份	7,246,525.00	2.93
62	600438	通威股份	7,141,110.00	2.88
63	601138	工业富联	7,103,885.60	2.87
64	300866	安克创新	7,088,399.00	2.86
65	600276	恒瑞医药	7,038,128.72	2.84
66	600583	海油工程	6,983,019.00	2.82
67	002056	横店东磁	6,971,796.00	2.82
68	600566	济川药业	6,905,925.80	2.79
69	002142	宁波银行	6,864,868.08	2.77
70	002179	中航光电	6,840,643.80	2.76
71	600028	中国石化	6,814,241.70	2.75
72	002273	水晶光电	6,786,760.00	2.74
73	000001	平安银行	6,780,050.60	2.74
74	300751	迈为股份	6,761,489.00	2.73
75	688126	沪硅产业	6,720,056.59	2.71
76	002966	苏州银行	6,705,686.40	2.71

77	002050	三花智控	6,650,432.00	2.69
78	600150	中国船舶	6,591,920.00	2.66
79	601601	中国太保	6,546,002.00	2.64
80	600958	东方证券	6,501,018.30	2.63
81	600098	广州发展	6,432,662.00	2.60
82	600919	江苏银行	6,346,471.00	2.56
83	600837	海通证券	6,203,136.00	2.51
84	600233	圆通速递	6,195,535.00	2.50
85	000157	中联重科	6,065,782.00	2.45
86	600089	特变电工	6,064,010.13	2.45
87	600031	三一重工	6,056,175.00	2.45
88	002568	百润股份	5,993,999.00	2.42
89	003012	东鹏控股	5,974,750.00	2.41
90	601838	成都银行	5,952,977.00	2.40
91	600557	康缘药业	5,825,592.67	2.35
92	688556	高测股份	5,817,684.01	2.35
93	601958	金钼股份	5,816,810.00	2.35
94	300638	广和通	5,795,583.80	2.34
95	600372	中航机载	5,774,660.09	2.33
96	600481	双良节能	5,762,137.64	2.33
97	002236	大华股份	5,754,387.99	2.32
98	002304	洋河股份	5,698,479.00	2.30
99	600066	宇通客车	5,636,985.93	2.28
100	600312	平高电气	5,573,000.00	2.25
101	600420	国药现代	5,566,424.00	2.25
102	000725	京东方 A	5,527,469.00	2.23
103	002463	沪电股份	5,519,027.80	2.23
104	603338	浙江鼎力	5,496,419.00	2.22
105	688687	凯因科技	5,436,526.30	2.20
106	603027	千禾味业	5,418,239.60	2.19
107	688617	惠泰医疗	5,408,643.25	2.18

108	601689	拓普集团	5,379,047.31	2.17
109	002422	科伦药业	5,364,725.00	2.17
110	002612	朗姿股份	5,347,808.00	2.16
111	600803	新奥股份	5,313,592.00	2.15
112	002475	立讯精密	5,305,449.00	2.14
113	601658	邮储银行	5,262,933.00	2.13
114	601137	博威合金	5,215,257.00	2.11
115	601669	中国电建	5,202,795.00	2.10
116	603127	昭衍新药	5,201,368.32	2.10
117	000895	双汇发展	5,195,578.00	2.10
118	601128	常熟银行	5,181,410.00	2.09
119	300454	深信服	5,163,628.00	2.09
120	605108	同庆楼	5,088,911.00	2.06
121	600011	华能国际	5,087,290.00	2.05
122	002230	科大讯飞	5,079,749.20	2.05
123	002353	杰瑞股份	5,072,733.08	2.05
124	600600	青岛啤酒	5,065,836.00	2.05
125	601211	国泰君安	5,040,856.00	2.04
126	601916	浙商银行	5,019,806.00	2.03

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	3,041,774,124.79
卖出股票收入（成交）总额	2,921,306,410.24

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	21,133,283.01	5.15
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	21,133,283.01	5.15

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	019709	23国债16	171,000	17,189,482.19	4.19
2	019703	23国债10	24,000	2,434,073.42	0.59
3	019727	23国债24	15,000	1,509,727.40	0.37

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
无。

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
无。

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
无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策
无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

8.12 投资组合报告附注

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

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	107,801.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	107,801.79

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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	3,232	59,330.50	88,688,014.30	46.25%	103,068,170.67	53.75%
博道久航混合C	2,180	76,067.16	109,013,133.45	65.74%	56,813,266.74	34.26%
合计	5,281	67,711.15	197,701,147.75	55.29%	159,881,437.41	44.71%

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	216,112.02	0.11%
	博道久航混合C	331.38	0.00%
	合计	216,443.40	0.06%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	博道久航混合A	0~10
	博道久航混合C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	博道久航混合A	0~10
	博道久航混合C	-

	合计	0~10
--	----	------

§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	155,168,237.84	61,689,798.78
本报告期基金总申购份额	85,438,310.17	119,023,732.81
减：本报告期基金总赎回份额	48,850,363.04	14,887,131.40
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	191,756,184.97	165,826,400.19

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2023年6月6日聘任冯大伟同志担任资产托管部副总经理，王波同志不再担任资产托管部副总经理职务；于2023年6月26日聘任陈丹同志担任资产托管部总经理，魏东晞同志不再担任资产托管部总经理职务。

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

本报告期内托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	5,950,949,784.26	100.00%	3,697,297.35	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	33,207,257.50	100.00%	118,704,000.00	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	2023-01-13
2	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
3	博道久航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
4	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人承销证券的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-03
5	博道基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2023-03-31
6	博道久航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
7	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	2023-04-04

		披露网站	
8	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
9	博道久航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
10	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	2023-04-29
11	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
12	博道基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-06
13	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	2023-06-14
14	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	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	2023-06-29
15	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	2023-07-21
16	博道久航混合型证券投资基金2023年第二季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-21
17	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	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	2023-08-12
18	博道久航混合型证券投资基	公司网站、中国证监会基金	2023-08-12

	金基金合同	电子披露网站	
19	博道久航混合型证券投资基金（更新）招募说明书（2023年第1号）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-14
20	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	2023-08-14
21	博道基金管理有限公司关于运用自有资金投资旗下权益基金的公告	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	2023-08-24
22	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	2023-08-31
23	博道久航混合型证券投资基金2023年中期报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-31
24	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安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	2023-09-21
25	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	2023-10-25
26	博道久航混合型证券投资基金2023年第三季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-10-25
27	博道基金管理有限公司关于旗下基金开展直销转换费率优惠活动的公告	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	2023-11-24
28	博道久航混合型证券投资基金（更新）招募说明书（2023年第2号）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-25
29	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	2023-11-25

30	博道基金管理有限公司关于旗下证券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	2023-12-22
31	博道基金管理有限公司关于增加中国光大银行股份有限公司为博道久航混合型证券投资基金销售机构的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-27
32	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海华夏财富投资管理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	2023-12-27
33	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧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	2023-12-28

§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。

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
二〇二四年三月二十九日