

博道红利智航股票型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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:广发证券股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月28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2024年01月01日起至2024年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	60
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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62

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	63
§9 开放式基金份额变动	63
§10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
§12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道红利智航股票型证券投资基金	
基金简称	博道红利智航股票	
基金主代码	019124	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年10月31日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	844,048,890.91份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道红利智航股票A	博道红利智航股票C
下属分级基金的交易代码	019124	019125
报告期末下属分级基金的份额总额	429,183,095.46份	414,865,795.45份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注红利主题相关上市公司股票的投资机会，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金，重点关注红利主题相关上市公司股票的投资机会，选取中证红利指数为业绩比较基准中股票部分的基准指数，通过量化选股模型构建股票组合，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。本基金所定义的红利主题相关股票是指满足以下第1)项和第2)项中任一项条件的上市公司发行的股票：1) 中证红利指数成份股和备选成份股；2) 在过去两年中，至少有一年实施现金分红且现金分红率（现金分红/净利润）或股息率（现金分红/市值）处于市场前50%。然后，个股综合考虑股票的估值、成长、盈利能力、营运质量、事件性因素、价量特征等因子，对股票进行综合评价后，挑选符合一定标准的股票用于构建股票组合，其中投资于本基金界定的红利主题相关股票

	的比例不低于非现金基金资产的80%。最后，利用投资组合优化工具，最大化组合的预期收益，以此来确定个股的投资权重，并根据市场的变化及时调整投资组合，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。本基金的股指期货投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、参与融资业务的策略和存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博道基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛	罗琦
	联系电话	021-80226288	020-66338888
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		400-085-2888	95575
传真		021-80226289	020-87553363-6847
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼
邮政编码		200122	510627
法定代表人		莫泰山	林传辉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正	www.bdfund.cn

文的管理人互联网网 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 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	博道红利智航股票 A	博道红利智航股票 C
本期已实现收益	29,046,006.79	10,027,589.13
本期利润	23,002,197.06	6,489,214.50
加权平均基金份额本期利润	0.0519	0.0232
本期加权平均净值利润率	4.94%	2.23%
本期基金份额净值增长率	6.49%	6.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	26,833,165.52	24,760,259.57
期末可供分配基金份额利润	0.0625	0.0597
期末基金资产净值	456,016,260.98	439,626,055.02
期末基金份额净值	1.0625	1.0597
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	6.25%	5.97%

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

博道红利智航股票A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-3.32%	0.73%	-5.28%	0.72%	1.96%	0.01%
过去三个月	0.40%	0.70%	-0.44%	0.77%	0.84%	-0.07%
过去六个月	6.49%	0.90%	7.39%	0.90%	-0.90%	0.00%
自基金合同 生效起至今	6.25%	0.79%	6.98%	0.80%	-0.73%	-0.01%

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。

博道红利智航股票C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-3.35%	0.73%	-5.28%	0.72%	1.93%	0.01%
过去三个月	0.30%	0.70%	-0.44%	0.77%	0.74%	-0.07%
过去六个月	6.29%	0.90%	7.39%	0.90%	-1.10%	0.00%
自基金合同 生效起至今	5.97%	0.79%	6.98%	0.80%	-1.01%	-0.01%

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

博道红利智航股票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
(2023年10月31日-2024年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2023年10月31日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。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。

博道红利智航股票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
(2023年10月31日-2024年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2023年10月31日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。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，注册资本金为1亿元人民币。截至报告期末，公司旗下发行并管理了29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、博道红利智航股票型证券投资基金和博道明远混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨梦	博道中证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、博道成长智航股票、博道中证1000指数增强、博道红利智	2023-10-31	-	13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

	航股票的基金经理、 量化投资总监兼量 化投资部总经理				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 任量化投资总监兼量化投 资部总经理。具有基金从业 资格。自2018年8月10日至2 024年4月27日担任博道启 航混合型证券投资基金基 金经理、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日至 2024年4月27日担任博道消 费智航股票型证券投资基 金基金经理、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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等，本基金管理人未发现违反公平交易制度的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，本公司管理的所有投资组合参与交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况共发生2次，经检查未发现异常；本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024年上半年，开年在小盘风险暴露、流动性负反馈作用下，市场情绪下降迅速，随后长期资金入市，市场出现V型反弹；二季度PMI边际回落，企业盈利仍然较弱。整体上半年，沪深300上涨0.89%，中证500下跌8.96%，中证1000下跌16.84%，上证指数下跌0.25%，创业板指下跌10.99%，恒生指数上涨3.94%。从行业来看，银行、煤炭、石油

石化、家电表现较好，分别上涨了19.19%、12.79%、11.36%、10.77%，消费者服务、计算机、商贸零售、传媒表现较差，分别下跌23.82%、21.62%、21.47%、21.45%。

从因子层面来看，由于2024年一季度市场波动率大幅提升，各大类因子表现分化，算法量价类因子在市场规律不明晰的情况下表现较弱，基本面和估值类因子表现较好。二季度市场环境企稳以后，基本面和估值类因子表现持续强势，AI量价表现也震荡上行。风险因子中，市值因子和非线性市值因子在一季度经历了较大的回撤，而通常量化增强类产品为了追求更大的超额空间，一般都会适度承担一定市值敞口的暴露，因此在风险因子高波动环境下，该类产品的运作经历了一次大考。

博道“指数+”系列产品对标不同的BETA，为适配不同风险偏好以及不同BETA配置需求的投资者，模型设置的风控参数也有所不同。少部分追求超额弹性、风险因子暴露略高的产品受到了市场环境的影响，超额出现了一定的波动；大部分产品风险因子暴露适中，超额波动较小且修复较快。在这轮市场考验过后，博道“指数+”系列产品在维持均衡的因子配置和较低的风格暴露下正常运行，模型层面我们继续在传统多因子模型和AI全流程多因子模型两套框架下持续迭代。

报告期间，本基金维持配置中证红利指数多因子选股增强模型。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2024年下半年，随着中国地产供求形势和新均衡的形成，我国将从债务驱动的高杠杆增长阶段，逐渐进入到创新驱动的高质量增长时代。对应的资本市场监管和金融统计方式都在发生变化，包括新国九条开启资本市场建设的新篇章、二季度统计局的金融增加值核算方式优化调整等，三中全会也勾勒了包括财税、要素市场化等更深层次的治理框架，相关政策红利可能成为新的投资线索。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的投资研究相

关人员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司估值委员会审批。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对博道红利智航股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，博道基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何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真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对博道基金管理有限公司编制和披露的博道红利智航股票型证券投资基金2024年中期报告中的财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博道红利智航股票型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	27,143,427.35	18,565,937.26
结算备付金		29,086.06	28,798.61
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	877,819,636.35	644,622,930.49
其中：股票投资		832,180,404.66	609,540,303.09
基金投资		-	-
债券投资		45,639,231.69	35,082,627.40
资产支持证券 投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,376,192.76	72,861.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		906,368,342.52	663,290,528.09
负 债 和 净 资 产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023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		6,199,998.30	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,303,869.33	-
应付管理人报酬		845,769.25	676,019.85
应付托管费		140,961.50	112,669.98
应付销售服务费		129,116.32	156,303.90
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	106,311.82	60,000.00
负债合计		10,726,026.52	1,004,993.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	844,048,890.91	664,139,550.71
未分配利润	6.4.7.8	51,593,425.09	-1,854,016.35
净资产合计		895,642,316.00	662,285,534.36
负债和净资产总计		906,368,342.52	663,290,528.09

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：博道红利智航股票型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年01月01日至2024年0 6月30日
一、营业总收入		35,466,734.13

1.利息收入		69,989.49
其中：存款利息收入	6.4.7.9	69,989.19
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		0.30
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		43,964,659.12
其中：股票投资收益	6.4.7.10	21,078,076.67
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	464,764.56
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
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	22,421,817.89
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	-9,582,184.36
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	1,014,269.88
减：二、营业总支出		5,975,322.57
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	4,514,915.24
2.托管费	6.4.10.2.2	752,485.89
3.销售服务费		574,976.84
4.投资顾问费		-
5.利息支出		48,409.24
其中：卖出回购金融资产支出		48,409.24
6.信用减值损失		-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.17	84,535.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,491,411.56

减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,491,411.56
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		29,491,411.56

6.3 净资产变动表

会计主体：博道红利智航股票型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	664,139,550.71	-1,854,016.35	662,285,534.36
二、本期期初净资产	664,139,550.71	-1,854,016.35	662,285,534.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	179,909,340.20	53,447,441.44	233,356,781.64
（一）、综合收益总额	-	29,491,411.56	29,491,411.56
（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）	179,909,340.20	23,956,029.88	203,865,370.08
其中：1.基金申购款	863,355,175.91	46,810,792.04	910,165,967.95
2.基金赎回款	-683,445,835.71	-22,854,762.16	-706,300,597.87
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少	-	-	-

以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	844,048,890.91	51,593,425.09	895,642,316.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

莫泰山	张丽	严娅
-----	-----	-----
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博道红利智航股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]1633号《关于准予博道红利智航股票型证券投资基金注册的批复》注册，由博道基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道红利智航股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币662,485,241.96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（2023）第0528号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道红利智航股票型证券投资基金基金合同》于2023年10月31日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为662,747,308.19份基金份额，其中认购资金利息折合262,066.23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，基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《博道红利智航股票型证券投资基金基金合同》和《博道红利智航股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金两类基金份额分别设置代码，分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道红利智航股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存

款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于80%，投资于本基金界定的红利主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或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红利指数收益率 $\times 95\%$ +同期银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

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》、《博道红利智航股票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2024年01月01日至2024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2024年06月30日的财务状况以及2024年01月01日至2024年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	2,416,456.02
等于：本金	2,415,356.71
加：应计利息	1,099.31
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	24,726,971.33
等于：本金	24,724,772.93
加：应计利息	2,198.40
减：坏账准备	-
合计	27,143,427.35

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 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	842,989,235.64	-	832,180,404.66	-10,808,830.98

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	44,991,795.00	569,461.69	45,639,231.69	77,975.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	44,991,795.00	569,461.69	45,639,231.69	77,975.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		887,981,030.64	569,461.69	877,819,636.35	-10,730,855.98

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

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	538.96
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	24,863.02
预提费用-信息披露费	59,672.34
其他应付	21,237.50
合计	106,311.82

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 博道红利智航股票A

金额单位：人民币元

项目 (博道红利智航股票A)	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	203,534,304.79	203,534,304.79
本期申购	415,300,922.98	415,300,922.98
本期赎回（以“-”号填列）	-189,652,132.31	-189,652,132.31
本期末	429,183,095.46	429,183,095.46

6.4.7.7.2 博道红利智航股票C

金额单位：人民币元

项目 (博道红利智航股票C)	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	460,605,245.92	460,605,245.92
本期申购	448,054,252.93	448,054,252.93
本期赎回（以“-”号填列）	-493,793,703.40	-493,793,703.40
本期末	414,865,795.45	414,865,795.45

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 博道红利智航股票A

单位：人民币元

项目 (博道红利智航股票A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-118,732.36	-355,361.89	-474,094.25
本期期初	-118,732.36	-355,361.89	-474,094.25
本期利润	29,046,006.79	-6,043,809.73	23,002,197.06
本期基金份额交易产生的变动数	2,202,439.07	2,102,623.64	4,305,062.71
其中：基金申购款	3,228,179.56	8,354,370.54	11,582,550.10
基金赎回款	-1,025,740.49	-6,251,746.90	-7,277,487.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,129,713.50	-4,296,547.98	26,833,165.52

6.4.7.8.2 博道红利智航股票C

单位：人民币元

项目 (博道红利智航股票C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-576,266.17	-803,655.93	-1,379,922.10
本期期初	-576,266.17	-803,655.93	-1,379,922.10
本期利润	10,027,589.13	-3,538,374.63	6,489,214.50
本期基金份额交易产生的变动数	19,430,798.73	220,168.44	19,650,967.17
其中：基金申购款	21,969,310.12	13,258,931.82	35,228,241.94
基金赎回款	-2,538,511.39	-13,038,763.38	-15,577,274.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,882,121.69	-4,121,862.12	24,760,259.57

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
----	-------------------------------

活期存款利息收入	29,510.58
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	40,191.16
结算备付金利息收入	287.45
其他	-
合计	69,989.19

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	2,852,212,285.48
减：卖出股票成本总额	2,826,248,868.22
减：交易费用	4,885,340.59
买卖股票差价收入	21,078,076.67

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 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	379,042.96
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	85,721.60
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	464,764.56

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 2024年01月01日至2024年06月30日
----	-------------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	22,190,117.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	21,899,240.00
减：应计利息总额	205,101.83
减：交易费用	54.40
买卖债券差价收入	85,721.60

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	22,421,817.89
基金投资产生的股利收益	-
合计	22,421,817.89

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-9,582,184.36
——股票投资	-9,570,117.36
——债券投资	-12,067.00
——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	-9,582,184.36

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	1,006,953.60
转换费收入	7,316.28
合计	1,014,269.88

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 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
合计	84,535.36

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

无。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。经博道基金管理有限公司(以下简称“博道基金”)股东会决议批准，史伟将持有的占比3.35%公司股权转让于上海博道相形投资合伙企业(有限合伙)，将持有的占比0.4%公司股权转让于张迎军。博道基金于2024年8月8日完成了工商变更登记手续。

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
广发证券股份有限公司	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

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 2024年01月01日至2024年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
广发证券股份有限公司	2,414,880,492.81	40.87%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
广发证券股份有限公司	20,811,825.00	38.44%

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 2024年01月01日至2024年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
广发证券股份有限公司	211,302,000.00	35.87%

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 2024年01月01日至2024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
广发证券股份有限公司	1,259,108.14	40.87%	-	-

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 2024年01月01日至2024年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,514,915.24
其中：应支付销售机构的客户维护费	995,415.36
应支付基金管理人的净管理费	3,519,499.88

注:支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	752,485.89

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.20%/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 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道红利智航股票A	博道红利智航股票C	合计
博道基金 管理有限 公司	-	0.86	0.86
广发证券 股份有限 公司	-	256,724.61	256,724.61

合计	-	256,725.47	256,725.47
----	---	------------	------------

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0.40%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×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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

上海博道投资管理有限公司及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：无。）

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司	5,699,438.95	16,952.04

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

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6个月以上	创业板打新限售	126.89	188.01	691	87,680.99	129,914.91	-
301589	诺瓦星云	2024-05-30	1-6个月（含）	创业板打新限售送股	-	188.01	553	-	103,969.53	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月以上	科创板打新限售	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内（含）	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
688709	成都华微	2024-01-31	6个月以上	科创板打新限售	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
603350	安乃达	2024-06-26	1个月内（含）	新股未上	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-

				市						
301536	星宸科技	2024-03-20	6个月以上	创业板打新限售	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月以上	主板打新限售	16.20	15.96	934	15,130.80	14,906.64	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月以上	科创板打新限售	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月以上	创业板打新限售	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024-05-22	1-6个月(含)	创业板打新限售送股	-	91.24	42	-	3,832.08	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月以上	创业板打新限售	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月以上	创业板打新限售	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月以上	科创板打新限售	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-

301566	达利凯普	2023-12-22	6个月以上	创业板打新限售	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月以上	创业板打新限售	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月以上	创业板打新限售	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月以上	创业板打新限售	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024-03-26	6个月以上	主板打新限售	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月以上	创业板打新限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月以上	科创板打新限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6个月以上	科创板打新限售	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024-03-06	6个月以上	创业板打	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-

				新限售						
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月以上	创业板打新限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6个月以上	主板打新限售	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月以上	主板打新限售	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
603344	星德胜	2024-03-13	6个月以上	主板打新限售	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月以上	主板打新限售	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603312	西典新能	2024-01-04	6个月以上	主板打新限售	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自科技	2024-01-23	6个月以上	主板打新限售	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月以上	主板打新限售	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6个月以上	主板打新限售	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月以上	主板打新限售	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-

001387	雪祺电气	2024-06-03	1-6个月（含）	主板打新限售送股	-	15.25	40	-	610.00	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月以上	主板打新限售	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月以上	主板打新限售	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300630	普利制药	2024-05-06	重大事项	8.65	2024-07-08	9.88	5,100	73,533.00	44,115.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额6,199,998.30元，截至2024年7月1日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人广发证券开立于交通银行股份有限公司的托管账户，其他存款存放于中信证券股份有限公司、广发证券股份有限公司和中信建投证券股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于2024年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2023年12月31日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2024年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有6,199,998.30元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2024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0.06%。

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2024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902,488,380.94元，超过经确认的当日净赎回金额。

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

产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	27,143,427.35	-	-	-	-	-	27,143,427.35
结算备付金	29,086.06	-	-	-	-	-	29,086.06
交易性金融资产	13,101,434.38	-	32,537,797.31	-	-	832,180,404.66	877,819,636.35
应收申购款	-	-	-	-	-	1,376,192.76	1,376,192.76
资产总计	40,273,947.79	-	32,537,797.31	-	-	833,556,597.42	906,368,342.52
负债							

卖出回 购金融 资产款	6,199,998.30	-	-	-	-	-	6,199,998.30
应付赎 回款	-	-	-	-	-	3,303,869.33	3,303,869.33
应付管 理人报 酬	-	-	-	-	-	845,769.25	845,769.25
应付托 管费	-	-	-	-	-	140,961.50	140,961.50
应付销 售服务 费	-	-	-	-	-	129,116.32	129,116.32
其他负 债	-	-	-	-	-	106,311.82	106,311.82
负债总 计	6,199,998.30	-	-	-	-	4,526,028.22	10,726,026.52
利率敏 感度缺 口	34,073,949.49	-	32,537,797.31	-	-	829,030,569.20	895,642,316.00
上年度 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	18,565,937.26	-	-	-	-	-	18,565,937.26
结算备 付金	28,798.61	-	-	-	-	-	28,798.61
交易性 金融资 产	-	-	35,082,627.40	-	-	609,540,303.09	644,622,930.49
应收申 购款	-	-	-	-	-	72,861.73	72,861.73
资产总 计	18,594,735.87	-	35,082,627.40	-	-	609,613,164.82	663,290,528.09
负债							
应付管 理人报 酬	-	-	-	-	-	676,019.85	676,019.85
应付托	-	-	-	-	-	112,669.98	112,669.98

管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	156,303.90	156,303.90
其他负债	-	-	-	-	-	60,000.00	60,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,004,993.73	1,004,993.73
利率敏感度缺口	18,594,735.87	-	35,082,627.40	-	-	608,608,171.09	662,285,534.36

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2024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5.10% (2023年12月31日：5.30%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响 (2023年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产不低于基金资产的80%，投资于本基金界定的红利主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存

出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023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	832,180,404.66	92.91	609,540,303.09	92.04
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	832,180,404.66	92.91	609,540,303.09	92.04

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证红利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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	1.中证红利指数收益率	39,736,890.83	29,402,245.92

	上升5%		
	2.中证红利指数收益率 下降5%	-39,736,890.83	-29,402,245.92

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	831,608,164.78	609,451,174.21
第二层次	45,684,842.80	35,082,627.40
第三层次	526,628.77	89,128.88
合计	877,819,636.35	644,622,930.49

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)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	832,180,404.66	91.81
	其中：股票	832,180,404.66	91.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	45,639,231.69	5.04
	其中：债券	45,639,231.69	5.04
	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	27,172,513.41	3.00
8	其他各项资产	1,376,192.76	0.15
9	合计	906,368,342.52	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	148,692,422.63	16.60
C	制造业	270,148,410.15	30.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,497,474.00	3.52
E	建筑业	21,422,142.00	2.39
F	批发和零售业	16,812,255.00	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	80,447,866.54	8.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,495,337.02	0.73
J	金融业	197,431,490.48	22.04
K	房地产业	16,058,436.00	1.79
L	租赁和商务服务业	13,571,709.50	1.52
M	科学研究和技术服务业	457,368.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	14,906.64	0.00
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	29,130,586.70	3.25
S	综合	-	-
	合计	832,180,404.66	92.91

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	4,644,900	20,251,764.00	2.26
2	601077	渝农商行	3,948,900	19,823,478.00	2.21

3	600282	南钢股份	3,958,300	19,712,334.00	2.20
4	600971	恒源煤电	1,634,720	19,518,556.80	2.18
5	601988	中国银行	4,138,800	19,121,256.00	2.13
6	600295	鄂尔多斯	1,898,376	18,831,889.92	2.10
7	601398	工商银行	3,270,600	18,642,420.00	2.08
8	600985	淮北矿业	1,064,353	17,817,269.22	1.99
9	601998	中信银行	2,647,545	17,738,551.50	1.98
10	600188	兖矿能源	774,470	17,603,703.10	1.97
11	601857	中国石油	1,660,200	17,133,264.00	1.91
12	600377	宁沪高速	1,356,000	17,085,600.00	1.91
13	601939	建设银行	2,208,518	16,343,033.20	1.82
14	601818	光大银行	5,016,700	15,902,939.00	1.78
15	600997	开滦股份	2,298,100	15,764,966.00	1.76
16	601668	中国建筑	2,945,000	15,637,950.00	1.75
17	600019	宝钢股份	2,343,100	15,581,615.00	1.74
18	601225	陕西煤业	595,663	15,350,235.51	1.71
19	600873	梅花生物	1,526,100	15,291,522.00	1.71
20	600348	华阳股份	1,529,700	15,235,812.00	1.70
21	600177	雅戈尔	2,135,128	15,202,111.36	1.70
22	600900	长江电力	514,500	14,879,340.00	1.66
23	601169	北京银行	2,450,300	14,309,752.00	1.60
24	600674	川投能源	745,400	13,976,250.00	1.56
25	600919	江苏银行	1,751,500	13,013,645.00	1.45
26	600012	皖通高速	931,100	13,007,467.00	1.45
27	601000	唐山港	2,652,200	12,465,340.00	1.39
28	000651	格力电器	314,200	12,322,924.00	1.38
29	600901	江苏金租	2,381,400	12,026,070.00	1.34
30	601088	中国神华	269,500	11,957,715.00	1.34
31	600741	华域汽车	712,700	11,674,026.00	1.30
32	600350	山东高速	1,296,900	11,477,565.00	1.28
33	601019	山东出版	949,935	11,228,231.70	1.25

34	600704	物产中大	2,564,900	11,131,666.00	1.24
35	601098	中南传媒	804,800	9,995,616.00	1.12
36	601328	交通银行	1,325,900	9,904,473.00	1.11
37	002088	鲁阳节能	793,900	9,598,251.00	1.07
38	601006	大秦铁路	1,296,735	9,284,622.60	1.04
39	600398	海澜之家	1,000,000	9,240,000.00	1.03
40	600064	南京高科	1,332,500	8,088,275.00	0.90
41	000983	山西焦煤	772,600	7,965,506.00	0.89
42	600028	中国石化	1,205,300	7,617,496.00	0.85
43	603565	中谷物流	859,131	7,508,804.94	0.84
44	600546	山煤国际	512,500	7,492,750.00	0.84
45	002327	富安娜	730,172	7,338,228.60	0.82
46	600015	华夏银行	957,200	6,126,080.00	0.68
47	000157	中联重科	783,000	6,013,440.00	0.67
48	002404	嘉欣丝绸	1,085,700	5,743,353.00	0.64
49	600057	厦门象屿	796,000	5,412,800.00	0.60
50	601699	潞安环能	281,100	5,096,343.00	0.57
51	601666	平煤股份	442,900	4,960,480.00	0.55
52	601919	中远海控	314,300	4,868,507.00	0.54
53	600039	四川路桥	602,200	4,751,358.00	0.53
54	000830	鲁西化工	390,500	4,525,895.00	0.51
55	601166	兴业银行	246,000	4,334,520.00	0.48
56	002443	金洲管道	768,000	4,101,120.00	0.46
57	002315	焦点科技	150,600	4,060,176.00	0.45
58	600782	新钢股份	1,193,200	3,961,424.00	0.44
59	600987	航民股份	547,000	3,861,820.00	0.43
60	000333	美的集团	59,300	3,824,850.00	0.43
61	600755	厦门国贸	531,750	3,812,647.50	0.43
62	002201	正威新材	760,500	3,597,165.00	0.40
63	002900	哈三联	385,200	3,536,136.00	0.39
64	601369	陕鼓动力	429,022	3,440,756.44	0.38

65	002601	龙佰集团	184,739	3,430,603.23	0.38
66	600035	楚天高速	772,700	3,314,883.00	0.37
67	002469	三维化学	567,000	3,231,900.00	0.36
68	600585	海螺水泥	127,300	3,003,007.00	0.34
69	600757	长江传媒	350,500	2,825,030.00	0.32
70	603948	建业股份	168,100	2,736,668.00	0.31
71	002416	爱施德	304,200	2,692,170.00	0.30
72	002824	和胜股份	203,200	2,592,832.00	0.29
73	601229	上海银行	347,403	2,522,145.78	0.28
74	603278	大业股份	401,900	2,495,799.00	0.28
75	301193	家联科技	156,000	2,489,760.00	0.28
76	002451	摩恩电气	457,700	2,457,849.00	0.27
77	601216	君正集团	623,600	2,301,084.00	0.26
78	600373	中文传媒	149,900	2,224,516.00	0.25
79	003002	壶化股份	202,600	2,222,522.00	0.25
80	603599	广信股份	179,000	2,171,270.00	0.24
81	600007	中国国贸	97,000	2,130,120.00	0.24
82	601009	南京银行	202,300	2,101,897.00	0.23
83	603788	宁波高发	169,700	2,083,916.00	0.23
84	002563	森马服饰	353,200	2,052,092.00	0.23
85	600016	民生银行	539,900	2,046,221.00	0.23
86	601928	凤凰传媒	179,900	1,971,704.00	0.22
87	000789	万年青	432,597	1,963,990.38	0.22
88	001228	永泰运	92,800	1,956,224.00	0.22
89	603353	和顺石油	150,800	1,954,368.00	0.22
90	002578	闽发铝业	726,700	1,911,221.00	0.21
91	002095	生意宝	150,600	1,843,344.00	0.21
92	002035	华帝股份	293,600	1,829,128.00	0.20
93	600663	陆家嘴	204,900	1,807,218.00	0.20
94	688606	奥泰生物	35,114	1,654,922.82	0.18
95	002048	宁波华翔	126,410	1,635,745.40	0.18

96	002879	长缆科技	119,900	1,574,287.00	0.18
97	300109	新开源	127,850	1,480,503.00	0.17
98	600479	千金药业	144,700	1,471,599.00	0.16
99	002737	葵花药业	58,700	1,372,406.00	0.15
100	605333	沪光股份	49,200	1,370,220.00	0.15
101	000533	顺钠股份	401,500	1,320,935.00	0.15
102	688800	瑞可达	46,167	1,296,369.36	0.14
103	600503	华丽家族	695,200	1,244,408.00	0.14
104	002043	兔宝宝	120,000	1,244,400.00	0.14
105	002660	茂硕电源	160,400	1,190,168.00	0.13
106	600863	内蒙华电	248,700	1,153,968.00	0.13
107	605080	浙江自然	71,200	1,126,384.00	0.13
108	688036	传音控股	14,576	1,115,647.04	0.12
109	000607	华媒控股	350,400	1,082,736.00	0.12
110	600036	招商银行	30,100	1,029,119.00	0.11
111	300952	恒辉安防	58,700	1,017,858.00	0.11
112	600803	新奥股份	48,600	1,010,880.00	0.11
113	600639	浦东金桥	94,500	964,845.00	0.11
114	600801	华新水泥	70,000	962,500.00	0.11
115	601001	晋控煤业	57,100	943,292.00	0.11
116	688049	炬芯科技	41,640	921,076.80	0.10
117	600488	津药药业	263,700	904,491.00	0.10
118	600222	太龙药业	204,500	858,900.00	0.10
119	603387	基蛋生物	108,700	843,512.00	0.09
120	601956	东贝集团	176,100	806,538.00	0.09
121	000429	粤高速 A	76,600	797,406.00	0.09
122	002304	洋河股份	9,800	791,252.00	0.09
123	601825	沪农商行	116,000	779,520.00	0.09
124	000906	浙商中拓	113,900	767,686.00	0.09
125	000708	中信特钢	56,500	766,705.00	0.09
126	002333	罗普斯金	142,400	764,688.00	0.09

127	002372	伟星新材	48,700	750,954.00	0.08
128	605337	李子园	69,300	680,526.00	0.08
129	000514	渝开发	214,500	673,530.00	0.08
130	000538	云南白药	13,000	664,950.00	0.07
131	603878	武进不锈	98,600	644,844.00	0.07
132	000926	福星股份	201,200	637,804.00	0.07
133	601318	中国平安	15,400	636,944.00	0.07
134	601658	邮储银行	117,700	596,739.00	0.07
135	002833	弘亚数控	30,400	554,496.00	0.06
136	301317	鑫磊股份	34,800	540,792.00	0.06
137	600502	安徽建工	124,200	534,060.00	0.06
138	301088	戎美股份	47,200	528,640.00	0.06
139	688665	四方光电	18,200	504,868.00	0.06
140	601186	中国铁建	58,200	498,774.00	0.06
141	000932	华菱钢铁	112,100	496,603.00	0.06
142	002267	陕天然气	63,100	477,036.00	0.05
143	300825	阿尔特	47,200	457,368.00	0.05
144	000404	长虹华意	77,400	412,542.00	0.05
145	603128	华贸物流	70,900	409,093.00	0.05
146	000555	神州信息	42,700	397,964.00	0.04
147	603309	维力医疗	35,800	394,158.00	0.04
148	601999	出版传媒	71,500	373,230.00	0.04
149	002343	慈文传媒	71,500	371,800.00	0.04
150	000550	江铃汽车	17,100	371,241.00	0.04
151	301187	欧圣电气	15,100	366,175.00	0.04
152	600929	雪天盐业	68,800	364,640.00	0.04
153	603038	华立股份	49,700	363,307.00	0.04
154	000951	中国重汽	25,300	362,296.00	0.04
155	300864	南大环境	18,480	362,208.00	0.04
156	002687	乔治白	84,100	353,220.00	0.04
157	300856	科思股份	11,000	352,110.00	0.04

158	600273	嘉化能源	49,000	349,860.00	0.04
159	301526	国际复材	97,225	323,759.25	0.04
160	002843	泰嘉股份	21,100	323,041.00	0.04
161	000026	飞亚达	35,200	310,112.00	0.03
162	002895	川恒股份	15,500	283,805.00	0.03
163	600325	华发股份	40,600	263,900.00	0.03
164	600173	卧龙地产	66,400	248,336.00	0.03
165	600810	神马股份	39,900	247,380.00	0.03
166	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.03
167	601598	中国外运	40,600	228,578.00	0.03
168	688533	上声电子	8,636	223,413.32	0.02
169	301015	百洋医药	8,300	195,299.00	0.02
170	601128	常熟银行	23,900	180,923.00	0.02
171	603648	畅联股份	22,400	177,408.00	0.02
172	002722	物产金轮	15,500	175,150.00	0.02
173	003025	思进智能	13,200	162,492.00	0.02
174	002615	哈尔斯	26,100	161,820.00	0.02
175	601096	宏盛华源	39,171	160,209.39	0.02
176	300770	新媒股份	4,400	146,872.00	0.02
177	601900	南方传媒	11,300	140,459.00	0.02
178	002863	今飞凯达	33,000	134,310.00	0.01
179	002692	远程股份	31,400	105,190.00	0.01
180	301566	达利凯普	5,755	97,662.35	0.01
181	301578	辰奕智能	1,527	60,423.39	0.01
182	300630	普利制药	5,100	44,115.00	0.00
183	603004	鼎龙科技	1,948	33,018.60	0.00
184	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
185	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
186	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
187	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
188	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00

189	601033	永兴股份	934	14,906.64	0.00
190	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
191	301538	骏鼎达	149	13,594.76	0.00
192	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
193	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
194	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
195	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
196	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
197	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
198	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
199	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
200	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
201	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
202	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
203	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
204	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
205	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
206	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
207	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
208	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
209	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
210	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
211	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
212	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	601857	中国石油	40,773,032.00	6.16
2	601019	山东出版	37,210,583.40	5.62
3	600985	淮北矿业	36,079,754.36	5.45
4	600295	鄂尔多斯	35,258,533.52	5.32
5	600971	恒源煤电	34,542,136.40	5.22
6	600282	南钢股份	34,185,106.00	5.16
7	600188	兖矿能源	32,211,256.50	4.86
8	601988	中国银行	30,737,004.00	4.64
9	600997	开滦股份	30,138,763.00	4.55
10	600348	华阳股份	29,937,341.50	4.52
11	601288	农业银行	29,035,404.00	4.38
12	601225	陕西煤业	28,856,561.16	4.36
13	601088	中国神华	28,752,958.50	4.34
14	601098	中南传媒	28,562,100.00	4.31
15	601006	大秦铁路	28,301,538.80	4.27
16	601169	北京银行	27,856,432.00	4.21
17	601818	光大银行	27,743,092.00	4.19
18	601998	中信银行	27,674,033.15	4.18
19	600546	山煤国际	27,663,312.00	4.18
20	000581	威孚高科	27,018,400.00	4.08
21	600873	梅花生物	26,822,904.00	4.05
22	600377	宁沪高速	26,415,707.00	3.99
23	600919	江苏银行	26,184,393.00	3.95
24	000651	格力电器	26,155,003.00	3.95
25	601077	渝农商行	26,072,063.00	3.94
26	600177	雅戈尔	25,225,001.88	3.81
27	600057	厦门象屿	25,223,701.00	3.81
28	600019	宝钢股份	25,176,863.00	3.80
29	600901	江苏金租	24,888,084.00	3.76
30	600350	山东高速	24,731,269.00	3.73
31	603565	中谷物流	24,729,643.44	3.73

32	600153	建发股份	24,495,908.12	3.70
33	601699	潞安环能	23,746,608.00	3.59
34	601398	工商银行	23,079,011.00	3.48
35	600674	川投能源	22,921,954.00	3.46
36	601000	唐山港	22,799,849.00	3.44
37	600741	华域汽车	22,598,629.00	3.41
38	601668	中国建筑	21,997,028.00	3.32
39	600900	长江电力	21,921,597.00	3.31
40	601666	平煤股份	21,654,755.00	3.27
41	002048	宁波华翔	21,583,433.06	3.26
42	600755	厦门国贸	20,997,751.50	3.17
43	600704	物产中大	20,636,534.00	3.12
44	601939	建设银行	20,527,318.40	3.10
45	600325	华发股份	20,408,066.60	3.08
46	002601	龙佰集团	20,161,626.80	3.04
47	601328	交通银行	19,847,610.00	3.00
48	600123	兰花科创	19,070,812.20	2.88
49	002416	爱施德	18,956,856.00	2.86
50	600012	皖通高速	18,738,427.00	2.83
51	600398	海澜之家	18,660,879.00	2.82
52	600479	千金药业	18,634,195.00	2.81
53	600028	中国石化	18,490,499.00	2.79
54	002088	鲁阳节能	18,404,248.00	2.78
55	600395	盘江股份	18,213,406.00	2.75
56	000157	中联重科	17,895,784.00	2.70
57	601636	旗滨集团	17,820,048.00	2.69
58	002327	富安娜	16,781,184.80	2.53
59	600585	海螺水泥	16,669,924.00	2.52
60	600064	南京高科	16,575,722.00	2.50
61	000932	华菱钢铁	16,404,134.00	2.48
62	000789	万年青	16,240,073.58	2.45

63	601997	贵阳银行	16,200,614.00	2.45
64	002003	伟星股份	15,927,031.73	2.40
65	601928	凤凰传媒	15,863,454.91	2.40
66	600015	华夏银行	15,843,601.00	2.39
67	000983	山西焦煤	15,509,703.00	2.34
68	600642	申能股份	14,929,620.00	2.25
69	601229	上海银行	14,864,853.00	2.24
70	603610	麒盛科技	14,650,161.00	2.21
71	002367	康力电梯	14,575,156.00	2.20
72	601601	中国太保	14,496,415.00	2.19
73	600782	新钢股份	14,277,986.00	2.16
74	002035	华帝股份	14,087,655.00	2.13
75	002443	金洲管道	14,087,270.00	2.13
76	603579	荣泰健康	13,769,070.00	2.08
77	600016	民生银行	13,663,798.00	2.06
78	000830	鲁西化工	13,386,980.00	2.02
79	603897	长城科技	13,307,776.00	2.01

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	601088	中国神华	34,567,662.00	5.22
2	600153	建发股份	33,937,344.48	5.12
3	600282	南钢股份	32,235,612.00	4.87
4	601169	北京银行	31,638,985.00	4.78
5	600325	华发股份	31,541,653.60	4.76
6	601098	中南传媒	31,421,549.59	4.74

7	601000	唐山港	30,173,491.00	4.56
8	601666	平煤股份	29,753,474.20	4.49
9	601019	山东出版	28,207,236.00	4.26
10	600123	兰花科创	27,804,865.92	4.20
11	000581	威孚高科	27,603,420.00	4.17
12	601006	大秦铁路	27,250,219.00	4.11
13	601857	中国石油	27,210,500.00	4.11
14	601328	交通银行	27,130,350.20	4.10
15	000932	华菱钢铁	26,670,270.44	4.03
16	600350	山东高速	26,336,222.00	3.98
17	002416	爱施德	25,924,716.00	3.91
18	600985	淮北矿业	25,273,727.00	3.82
19	002048	宁波华翔	25,120,483.00	3.79
20	002601	龙佰集团	23,850,102.99	3.60
21	601636	旗滨集团	23,522,274.00	3.55
22	600188	兖矿能源	23,495,246.00	3.55
23	600016	民生银行	23,213,297.00	3.51
24	600971	恒源煤电	23,002,583.70	3.47
25	600348	华阳股份	22,982,613.00	3.47
26	600997	开滦股份	22,927,944.82	3.46
27	600019	宝钢股份	22,805,035.84	3.44
28	600057	厦门象屿	22,791,356.00	3.44
29	601601	中国太保	22,758,926.00	3.44
30	600479	千金药业	22,726,700.00	3.43
31	600395	盘江股份	22,557,714.00	3.41
32	601988	中国银行	22,444,970.00	3.39
33	600546	山煤国际	22,244,412.00	3.36
34	601225	陕西煤业	21,829,335.00	3.30
35	600177	雅戈尔	21,378,231.00	3.23
36	600919	江苏银行	21,261,446.00	3.21
37	000651	格力电器	21,099,745.00	3.19

38	002367	康力电梯	21,008,952.00	3.17
39	601699	潞安环能	20,955,643.00	3.16
40	601288	农业银行	20,435,424.00	3.09
41	600801	华新水泥	20,399,670.80	3.08
42	600755	厦门国贸	20,079,626.00	3.03
43	600741	华域汽车	19,938,758.00	3.01
44	601398	工商银行	19,930,991.00	3.01
45	002003	伟星股份	19,739,257.24	2.98
46	600377	宁沪高速	19,429,215.00	2.93
47	600015	华夏银行	19,407,249.00	2.93
48	600295	鄂尔多斯	19,337,111.00	2.92
49	601818	光大银行	19,088,249.00	2.88
50	603565	中谷物流	18,411,018.83	2.78
51	000157	中联重科	18,365,644.00	2.77
52	601077	渝农商行	17,634,354.00	2.66
53	601229	上海银行	17,512,782.00	2.64
54	600642	申能股份	17,076,549.50	2.58
55	600873	梅花生物	16,735,094.00	2.53
56	601997	贵阳银行	16,212,281.86	2.45
57	002128	电投能源	16,202,820.00	2.45
58	600900	长江电力	15,861,837.00	2.40
59	600398	海澜之家	15,432,067.79	2.33
60	600028	中国石化	15,321,450.00	2.31
61	600389	江山股份	15,296,473.36	2.31
62	601668	中国建筑	15,015,823.00	2.27
63	601928	凤凰传媒	15,000,679.70	2.26
64	603610	麒盛科技	14,719,293.68	2.22
65	603579	荣泰健康	14,671,442.70	2.22
66	600585	海螺水泥	14,453,810.32	2.18
67	600757	长江传媒	14,432,172.18	2.18
68	000789	万年青	14,423,989.50	2.18

69	601939	建设银行	14,075,590.00	2.13
70	600901	江苏金租	14,018,531.00	2.12
71	603258	电魂网络	13,727,149.00	2.07
72	603886	元祖股份	13,620,755.00	2.06
73	000090	天健集团	13,599,524.00	2.05

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	3,058,459,087.15
卖出股票收入（成交）总额	2,852,212,285.48

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	45,639,231.69	5.10
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	45,639,231.69	5.10

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	019727	23国债24	181,000	18,429,246.44	2.06
2	019709	23国债16	129,000	13,101,434.38	1.46
3	019733	24国债02	83,000	8,389,064.68	0.94
4	019740	24国债09	57,000	5,719,486.19	0.64

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策
无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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）2023年8月15日，中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”，证券代码601288）因农户贷款发放后流入房地产企业等19项违法违规事实，收到国家金融监督管理总局没收违法所得并处罚款合计4420.184584万元的行政处罚（金罚决字〔2023〕8号），其中，对总行罚款1760.092292万元，没收违法所得60.092292万元，对分支机构罚款2600万元。2023年11月16日，农业银行因流动资金贷款被用于固定资产投资等13项主要违法违规事实，收到国家金融监督管理总局没收违法所得并处罚款合计2710.9738万元的行政处罚（金罚决字〔2023〕21号），其中，总行570.9738万元，分支机构2140万元。2023年11月17日，农业银行因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查等4项违法事实，被国家外汇管理局北京市分局给

予警告，没收违法所得1,418,524.70元人民币，并处553万元人民币罚款（京汇罚〔2023〕32号）。

2023年11月29日，中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”，证券代码601988）因违反账户管理规定等12项违法行为收到中国人民银行警告，没收违法所得37.340315万元，罚款3664.2万元的行政处罚（银罚决字〔2023〕93号）。2023年12月28日，中国银行因部分重要信息系统识别不全面，灾备建设和灾难恢复能力不符合监管要求等9项违法违规事实，收到国家金融监督管理总局罚款430万元的行政处罚（金罚决字〔2023〕68号）。2024年4月3日，中国银行因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查，收到国家外汇管理局北京市分局处40万元人民币罚款，没收违法所得2236.13元人民币的行政处罚（京汇罚〔2024〕9号）。

2023年11月16日，中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”，证券代码601998）因违反高管准入管理相关规定等56项主要违法违规事实，国家金融监督管理总局对中信银行总行罚款15242.59万元、没收违法所得462.59万元，对分支机构罚款6770万元，罚没合计22475.18万元（金罚决字〔2023〕15号）。2023年12月29日，中信银行因部分重要信息系统应认定未认定，相关系统未建灾备或灾难恢复能力不符合监管要求等6项主要违法违规事实，被国家金融监督管理总局罚款400万元（金罚决字〔2023〕69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	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,376,192.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	1,376,192.76

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
博道 红利 智航 股票A	2,069	207,435.04	349,640,681.42	81.47%	79,542,414.04	18.53%
博道 红利 智航 股票C	7,135	58,145.17	64,129,180.09	15.46%	350,736,615.36	84.54%
合计	9,109	92,660.98	413,769,861.51	49.02%	430,279,029.40	50.98%

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	博道红利智航股票A	295,555.09	0.07%
	博道红利智航股票C	18,996.33	0.00%
	合计	314,551.42	0.04%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	博道红利智航股票 A	0~10
	博道红利智航股票 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	博道红利智航股票 A	0
	博道红利智航股票 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道红利智航股票A	博道红利智航股票C
基金合同生效日(2023年10月31日)基金份额总额	202,896,047.39	459,851,260.80
本报告期期初基金份额总额	203,534,304.79	460,605,245.92
本报告期基金总申购份额	415,300,922.98	448,054,252.93
减：本报告期基金总赎回份额	189,652,132.31	493,793,703.40
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	429,183,095.46	414,865,795.45
--------------	----------------	----------------

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

基金管理人的重大人事变动：报告期内，经董事会审议通过，史伟先生不再担任公司副总经理。本公司已按规定将上述事项公告并报监管机构备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

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	
广发证券	2	2,414,880,492.81	40.87%	1,259,108.14	40.87%	-
中信建投证券	2	3,123,791,352.37	52.87%	1,628,480.95	52.86%	-
中信证券	2	370,091,168.56	6.26%	193,171.69	6.27%	-

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
广发证券	20,811,825.00	38.44%	211,302,000.00	35.87%	-	-	-	-
中信建投证券	24,818,009.00	45.84%	355,186,000.00	60.29%	-	-	-	-
中信证券	8,506,059.00	15.71%	22,646,000.00	3.84%	-	-	-	-

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关于旗下部分基金增加上海大智慧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	2024-01-12
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	2024-01-22
3	博道红利智航股票型证券投资基金2023年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-22
4	博道基金管理有限公司关于博道红利智航股票型证券投资基金开放日常赎回和转换转出业务的公告	上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-29
5	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-06
6	博道基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	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	2024-02-08
7	博道基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
8	博道红利智航股票型证券投	公司网站、中国证监会基金	2024-03-29

	资基金2023年年度报告	电子披露网站	
9	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	2024-04-22
10	博道红利智航股票型证券投资基金2024年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-22
11	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为销售机构的公告	上海证券报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-22
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	2024-06-07
13	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加国信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	2024-06-26
14	博道基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	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	2024-06-27
15	博道红利智航股票型证券投资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	2024-06-27

§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	20240104 - 20240630	-	328,046,385.35	-	328,046,385.35	38.87%

产品特有风险

本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道红利智航股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道红利智航股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道红利智航股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道红利智航股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道红利智航股票型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内博道红利智航股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人网站（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
二〇二四年八月三十日