

博道伍佰智航股票型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026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	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
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	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	71
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	71
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	71
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	71
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
7.12 投资组合报告附注	71
§8 基金份额持有人信息	72
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
8.2 盈利投资者数量占比	73

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
8.4 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	73
§9 开放式基金份额变动	73
§10 重大事件揭示	74
10.1 基金份额持有人大会决议	74
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	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
10.4 基金投资策略的改变	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	74
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	75
10.8 其他重大事件	76
§11 备查文件目录	77
11.1 备查文件目录	77
11.2 存放地点	77
11.3 查阅方式	77

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道伍佰智航股票型证券投资基金	
基金简称	博道伍佰智航	
基金主代码	007831	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年09月26日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	974,993,778.73份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道伍佰智航A	博道伍佰智航C
下属分级基金的交易代码	007831	007832
报告期末下属分级基金的份额总额	265,730,070.97份	709,263,707.76份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型基金，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，以股票投资为主。本基金业绩比较基准中股票资产部分以中证500指数为基准指数，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、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证500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	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛	王小飞
	联系电话	021-80226288	021-60637103
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-085-2888	021-60637228
传真		021-80226289	021-60635778
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200122	100033
法定代表人		莫泰山	张金良

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.bdfund.cn
基金中期报告置备地点	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
---------------	-----

	(2026年01月01日-2026年06月30日)	
	博道伍佰智航A	博道伍佰智航C
本期已实现收益	82,402,101.79	221,459,697.08
本期利润	95,984,591.08	266,378,810.92
加权平均基金份额本期利润	0.3606	0.3643
本期加权平均净值利润率	18.48%	19.12%
本期基金份额净值增长率	22.77%	22.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	267,659,471.98	680,777,702.11
期末可供分配基金份额利润	1.0073	0.9598
期末基金资产净值	583,322,771.27	1,520,975,508.72
期末基金份额净值	2.1952	2.1444
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	175.27%	169.77%

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

博道伍佰智航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	23.90%	1.70%	17.61%	1.56%	6.29%	0.14%
过去六个月	22.77%	1.59%	19.93%	1.58%	2.84%	0.01%
过去一年	49.23%	1.31%	49.68%	1.35%	-0.45%	-0.04%

过去三年	84.48%	1.39%	48.14%	1.41%	36.34%	-0.02%
过去五年	74.65%	1.32%	31.61%	1.30%	43.04%	0.02%
自基金合同生效起至今	175.27%	1.32%	73.99%	1.30%	101.28%	0.02%

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。

博道伍佰智航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	23.80%	1.70%	17.61%	1.56%	6.19%	0.14%
过去六个月	22.59%	1.59%	19.93%	1.58%	2.66%	0.01%
过去一年	48.78%	1.31%	49.68%	1.35%	-0.90%	-0.04%
过去三年	82.83%	1.39%	48.14%	1.41%	34.69%	-0.02%
过去五年	72.07%	1.32%	31.61%	1.30%	40.46%	0.02%
自基金合同生效起至今	169.77%	1.32%	73.99%	1.30%	95.78%	0.02%

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

博道伍佰智航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09月26日-2026年06月30日)



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

博道伍佰智航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09月26日-2026年06月30日)



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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博道基金管理有限公司由中国证监会证监许可〔2017〕822号文核准设立，于2017年6月12日成立，注册地在中国上海，注册资本为1亿元人民币。公司具备公开募集证券投资基金管理、私募资产管理等业务资格。公司管理的首只公募基金于2018年8月10日成立。截至报告期末，公司旗下管理的公募基金涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金等多种类型。

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、博道伍佰智航、博道成长智航股票、博道中证1000指数增强、博道大盘成长股票、博道沪深300指数量化增强、博道中证A500指数增强、博道中证800指数增强、博道上证科创板综合指数增强、博道中证全指指数增强、博道星航混合、博道衍和债券的基金经理、量化投资总监兼量化投资部总经理	2019-09-26	-	15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。具有基金从业资格。
刘兆阳	博道叁佰智航、博道伍佰智航、博道消费智航、博道红利智航	2025-07-23	-	4年	刘兆阳先生，中国籍，金融硕士。2022年7月加入博道基金管理有限公司，历任量

	股票、博道启航混合、博道沪深300指数量化增强、博道中证800指数增强的基金经理、量化投资部总经理助理				化投资部量化研究员、高级量化研究员。具有基金从业资格。
--	---	--	--	--	-----------------------------

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守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，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，为基金份额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，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

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4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

2026年上半年，受美以伊冲突、油价波动和流动性预期变化影响，全球市场剧烈震荡，风险偏好先抑后扬。A股主要宽基指数多数上涨，但结构分化明显，上证指数上涨3.16%，沪深300上涨7.55%，中证500上涨20.97%，中证1000上涨15.99%。风格上，中信成长风格指数上涨36.71%，中信周期风格指数下跌4.31%，中信消费风格指数下跌13.46%，中信金融风格指数下跌12.58%，中信稳定风格指数下跌6.36%。行业层面，电子、通信、建材涨幅居前，分别上涨85.49%、74.54%、43.70%，消费者服务、综合金融、综合跌幅较大，分别下跌31.88%、29.59%、25.09%。

从因子层面来看，表征景气度的基本面因子表现较好，价值类因子创下历史最大回撤，AI量价因子表现差异较大，部分因子策略捕捉到了较强的动量效应，部分因子策略偏量价反转逻辑。极致的抱团风格下，量化策略的环境并不友好。研究层面，博道量化团队继续围绕双均衡框架进行升级，以及推动组合优化与风控模块持续迭代。

报告期间，本基金维持配置中证500多因子选股增强模型（不受指数成分股占比约束的版本）。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，主要宽基指数的预期盈利增速仍处于抬升阶段，预计市场重心将继续围绕基本面和产业趋势展开；对于量化产品而言，需重点关注三四季度动量反转的可能性并做好防范应对。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§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：博道伍佰智航股票型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	52,757,630.50	56,054,427.24
结算备付金		7,601.86	7,571.81
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,056,752,063.03	1,548,863,092.93
其中：股票投资		1,951,461,272.81	1,465,511,049.89
基金投资		-	-
债券投资		105,290,790.22	83,352,043.04
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		4,494,324.94	1,770,760.08
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,114,011,620.33	1,606,695,852.06
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-

应付赎回款		6,842,191.18	10,428,306.42
应付管理人报酬		1,935,829.05	1,609,795.70
应付托管费		322,638.16	268,299.29
应付销售服务费		348,374.81	308,167.84
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,273.37	0.64
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	261,033.77	179,693.88
负债合计		9,713,340.34	12,794,263.77
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	974,993,778.73	906,508,517.59
未分配利润	6.4.7.7	1,129,304,501.26	687,393,070.70
净资产合计		2,104,298,279.99	1,593,901,588.29
负债和净资产总计		2,114,011,620.33	1,606,695,852.06

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：博道伍佰智航股票型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		377,803,867.60	112,852,620.38
1.利息收入		14,665.81	11,910.34
其中：存款利息收入	6.4.7.8	14,665.63	11,910.22
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		0.18	0.12
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		318,402,986.02	77,109,733.29
其中：股票投资收益	6.4.7.9	309,405,358.14	69,697,817.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	976,922.65	260,205.55
资产支持证券投资	6.4.7.11	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	8,020,705.23	7,151,710.00
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	58,501,603.13	35,549,374.16
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	884,612.64	181,602.59
减：二、营业总支出		15,440,465.60	5,575,799.22
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	11,376,099.12	4,090,139.82
2.托管费	6.4.10.2.2	1,896,016.57	681,689.98
3.销售服务费		2,073,383.06	712,244.05
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		1,057.24	4,799.46
其中：卖出回购金融资产支出		1,057.24	4,799.46
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		1,314.95	0.32
8.其他费用	6.4.7.16	92,594.66	86,925.59

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		362,363,402.00	107,276,821.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		362,363,402.00	107,276,821.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		362,363,402.00	107,276,821.16

6.3 净资产变动表

会计主体：博道伍佰智航股票型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026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	906,508,517.59	687,393,070.70	1,593,901,588.29
二、本期期初净资产	906,508,517.59	687,393,070.70	1,593,901,588.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	68,485,261.14	441,911,430.56	510,396,691.70
（一）、综合收益总额	-	362,363,402.00	362,363,402.00
（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）	68,485,261.14	79,548,028.56	148,033,289.70
其中：1.基金申购款	621,684,403.26	582,771,897.18	1,204,456,300.44
2.基金赎回款	-553,199,142.12	-503,223,868.62	-1,056,423,010.74

（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	974,993,778.73	1,129,304,501.26	2,104,298,279.99
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025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	537,277,211.50	136,450,669.31	673,727,880.81
二、本期期初净资产	537,277,211.50	136,450,669.31	673,727,880.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,145,196.69	106,483,093.69	109,628,290.38
（一）、综合收益总额	-	107,276,821.16	107,276,821.16
（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）	3,145,196.69	-793,727.47	2,351,469.22
其中：1.基金申购款	313,212,776.81	101,850,574.65	415,063,351.46
2.基金赎回款	-310,067,580.12	-102,644,302.12	-412,711,882.24
（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、本期期末净资产	540,422,408.19	242,933,763.00	783,356,171.19

产			
---	--	--	--

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

博道伍佰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[2019]1387号《关于准予博道伍佰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《博道伍佰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758,118,385.63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0519号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道伍佰智航股票型证券投资基金基金合同》于2019年9月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为758,452,093.92份基金份额，其中认购资金利息折合333,708.29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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《博道伍佰智航股票型证券投资基金基金合同》和《博道伍佰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《博道伍佰智航股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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）。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%。每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，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、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500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”)、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集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》《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和在财务报表附注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2026年01月01日至2026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2026年06月30日的财务状况以及2026年01月01日至2026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[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》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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。2027年12月31日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2027年12月31日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的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。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。

(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 2026年06月30日
活期存款	2,063,146.78
等于：本金	2,062,935.94
加：应计利息	210.84
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	50,694,483.72
等于：本金	50,693,745.79
加：应计利息	737.93
减：坏账准备	-
合计	52,757,630.50

注：其他存款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 2026年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,874,234,192.66	-	1,951,461,272.81	77,227,080.15
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所市场	104,583,212.07	711,360.22	105,290,790.22	-3,782.07
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	104,583,212.07	711,360.22	105,290,790.22	-3,782.07
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,978,817,404.73	711,360.22	2,056,752,063.03	77,223,298.08

注：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(如有)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 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	736.00
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	24,795.19

预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	175,995.21
合计	261,033.77

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 博道伍佰智航A

金额单位：人民币元

项目 (博道伍佰智航A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	209,466,431.28	209,466,431.28
本期申购	191,751,134.56	191,751,134.56
本期赎回（以“-”号填列）	-135,487,494.87	-135,487,494.87
本期末	265,730,070.97	265,730,070.97

6.4.7.6.2 博道伍佰智航C

金额单位：人民币元

项目 (博道伍佰智航C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	697,042,086.31	697,042,086.31
本期申购	429,933,268.70	429,933,268.70
本期赎回（以“-”号填列）	-417,711,647.25	-417,711,647.25
本期末	709,263,707.76	709,263,707.76

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。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 博道伍佰智航A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

(博道伍佰智航A)			
上年度末	141,410,630.17	23,659,533.40	165,070,163.57
本期期初	141,410,630.17	23,659,533.40	165,070,163.57
本期利润	82,402,101.79	13,582,489.29	95,984,591.08
本期基金份额交易产生的变动数	43,846,740.02	12,691,205.63	56,537,945.65
其中：基金申购款	154,666,373.85	28,180,002.33	182,846,376.18
基金赎回款	-110,819,633.83	-15,488,796.70	-126,308,430.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	267,659,471.98	49,933,228.32	317,592,700.30

6.4.7.7.2 博道伍佰智航C

单位：人民币元

项目 (博道伍佰智航C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	444,703,730.90	77,619,176.23	522,322,907.13
本期期初	444,703,730.90	77,619,176.23	522,322,907.13
本期利润	221,459,697.08	44,919,113.84	266,378,810.92
本期基金份额交易产生的变动数	14,614,274.13	8,395,808.78	23,010,082.91
其中：基金申购款	338,149,858.60	61,775,662.40	399,925,521.00
基金赎回款	-323,535,584.47	-53,379,853.62	-376,915,438.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	680,777,702.11	130,934,098.85	811,711,800.96

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	4,281.96
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	10,353.62

结算备付金利息收入	30.05
其他	-
合计	14,665.63

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	14,209,775,132.93
减：卖出股票成本总额	13,879,007,310.60
减：交易费用	21,362,464.19
买卖股票差价收入	309,405,358.14

6.4.7.10 债券投资收益

6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	627,983.52
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	348,939.13
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	976,922.65

6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	109,742,021.13

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	108,160,172.46
减：应计利息总额	1,232,881.94
减：交易费用	27.60
买卖债券差价收入	348,939.13

6.4.7.11 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	8,020,705.23
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,020,705.23

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	58,501,603.13
——股票投资	58,552,826.11
——债券投资	-51,222.98
——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	58,501,603.13

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	883,177.90
转换费收入	1,434.74
合计	884,612.64

注：

- 1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产；
 - 2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。
- 具体以本基金最新的招募说明书为准。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	8,292.10
合计	92,594.66

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、关联关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博道基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人

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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2026年01月01日至2026年06月30日	2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,376,099.12	4,090,139.82
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,896,047.80	1,251,119.70
应支付基金管理人的净管理费	8,480,051.32	2,839,020.12

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×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,896,016.57	681,689.98

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×该日适用费率/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 2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道伍佰智航A	博道伍佰智航C	合计
博道基金管理有限公司	-	584,853.82	584,853.82
合计	-	584,853.82	584,853.82
获得销售服务费的	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		

各关联方 名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道伍佰智航A	博道伍佰智航C	合计
博道基金 管理有限 公司	-	76,219.90	76,219.90
合计	-	76,219.90	76,219.90

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0.30%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×该日适用费率/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

博道伍佰智航A

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	319,697.30	319,697.30
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	319,697.30	319,697.30
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.12%	0.21%

博道伍佰智航C

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至	上年度可比期间 2025年01月01日至
----	--------------------	-------------------------

	2026年06月30日	2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	1,000,048.61	1,000,048.61
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	1,000,048.61	1,000,048.61
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.14%	0.26%

注：

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

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0~10万份。（上年度末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0~10万份。）

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	2,063,146.78	4,281.96	3,480,096.70	5,784.12

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

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——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2026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
688802	沐曦股份	2025-12-09	9个月	科创板打新限售	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6个月	主板打新限售	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
301666	大普微	2026-04-08	6个月	创业板打新限售	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	科创板打新限售	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9个月	科创板打新限售	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	科创板打新限售	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-

				售						
001248	华润新能源	2026-06-24	1个月内(含)	新股未上市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6个月	主板打新限售	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	科创板打新限售	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月	创业板打新限售	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6个月	科创板打新限售	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	科创板打新限售	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	科创板打新限售	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	科创板打新限售	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	科创板打	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-

				新限售						
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月	主板打新限售	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	主板打新限售	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026-05-11	6个月	主板打新限售	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研新材	2026-04-01	6个月	科创板打新限售	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月	创业板打新限售	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6个月	主板打新限售	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特电子	2026-06-02	6个月	创业板打新限售	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025-12-24	6个月	创业板打新限售	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
001393	维通利	2026-05-08	6个月	主板打新限售	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-

301531	春光集团	2026-04-28	6个月	创业板打新限售	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6个月	创业板打新限售	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	主板打新限售	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
301680	固德电材	2026-02-27	6个月	创业板打新限售	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月	创业板打新限售	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
688816	易思维	2026-02-04	6个月	科创板打新限售	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	主板打新限售	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6个月	创业板打新限售	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	主板打新限售	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-

603352	至信股份	2026-01-08	6个月	主板打新限售	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	主板打新限售	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月	主板打新限售	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月	主板打新限售	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6个月	主板打新限售	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的解限日和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

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中国建设银行，其他存款存放于浙商证券股份有限公司，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2026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(2025年12月31日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.01%)。

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2026年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度

指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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2026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0.30%。

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2026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2,100,820,527.97元，超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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 2026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	52,757,630.50	-	-	-	-	-	52,757,630.50
结算备付金	7,601.86	-	-	-	-	-	7,601.86
交易性金融资产	3,037,876.44	-	102,252,913.78	-	-	1,951,461,272.81	2,056,752,063.03
应收申购款	-	-	-	-	-	4,494,324.94	4,494,324.94
资产总计	55,803,108.80	-	102,252,913.78	-	-	1,955,955,597.75	2,114,011,620.33
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,842,191.18	6,842,191.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,935,829.05	1,935,829.05
应付托管费	-	-	-	-	-	322,638.16	322,638.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-	348,374.81	348,374.81
应交税费	-	-	-	-	-	3,273.37	3,273.37
其他负	-	-	-	-	-	261,033.77	261,033.77

债							
负债总计	-	-	-	-	-	9,713,340.34	9,713,340.34
利率敏感度缺口	55,803,108.80	-	102,252,913.78	-	-	1,946,242,257.41	2,104,298,279.99
上年度末 2025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	56,054,427.24	-	-	-	-	-	56,054,427.24
结算备付金	7,571.81	-	-	-	-	-	7,571.81
交易性金融资产	27,806,764.38	-	55,327,260.50	-	218,018.16	1,465,511,049.89	1,548,863,092.93
应收申购款	-	-	-	-	-	1,770,760.08	1,770,760.08
资产总计	83,868,763.43	-	55,327,260.50	-	218,018.16	1,467,281,809.97	1,606,695,852.06
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,428,306.42	10,428,306.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,609,795.70	1,609,795.70
应付托管费	-	-	-	-	-	268,299.29	268,299.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-	308,167.84	308,167.84
应交税费	-	-	-	-	-	0.64	0.64
其他负债	-	-	-	-	-	179,693.88	179,693.88
负债总计	-	-	-	-	-	12,794,263.77	12,794,263.77
利率敏感度缺	83,868,763.43	-	55,327,260.50	-	218,018.16	1,454,487,546.20	1,593,901,588.29

口							
---	--	--	--	--	--	--	--

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2026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5.00%(2025年12月31日：5.23%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2025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%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，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%，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 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,951,461,272.81	92.74	1,465,511,049.89	91.94
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	1,951,461,272.81	92.74	1,465,511,049.89	91.94

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证500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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	1.中证500指数收益率上升5%	115,358,517.50	81,367,026.21
	2.中证500指数收益率下降5%	-115,358,517.50	-81,367,026.21

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	1,945,114,058.10	1,452,140,422.99
第二层次	106,141,081.66	83,761,855.04
第三层次	5,496,923.27	12,960,814.90
合计	2,056,752,063.03	1,548,863,092.93

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

无。

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	1,951,461,272.81	92.31
	其中：股票	1,951,461,272.81	92.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	105,290,790.22	4.98
	其中：债券	105,290,790.22	4.98
	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	52,765,232.36	2.50
8	其他各项资产	4,494,324.94	0.21
9	合计	2,114,011,620.33	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	70,774,598.82	3.36
C	制造业	1,582,475,535.75	75.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,068,693.44	1.00
E	建筑业	14,739,882.00	0.70
F	批发和零售业	44,506,773.50	2.12
G	交通运输、仓储和邮政业	13,052,835.46	0.62
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,971,963.83	2.80
J	金融业	94,890,597.97	4.51
K	房地产业	782,667.00	0.04
L	租赁和商务服务业	12,549,553.44	0.60
M	科学研究和技术服务业	17,068,966.00	0.81
N	水利、环境和公共设施管理业	18,563,673.60	0.88
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	2,015,532.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	1,951,461,272.81	92.74

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
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	001309	德明利	43,040	40,582,416.00	1.93
2	300857	协创数据	91,285	31,027,771.50	1.47
3	300475	香农芯创	89,407	26,822,100.00	1.27
4	002281	光迅科技	98,200	25,231,508.00	1.20
5	300604	长川科技	66,723	22,780,566.66	1.08
6	002851	麦格米特	131,889	22,049,203.02	1.05
7	301377	鼎泰高科	36,500	20,107,850.00	0.96
8	300073	当升科技	411,946	19,789,885.84	0.94
9	600498	烽火通信	244,400	17,987,840.00	0.85
10	300308	中际旭创	12,700	16,129,000.00	0.77

11	002384	东山精密	61,204	16,056,869.40	0.76
12	300121	阳谷华泰	1,241,800	15,646,680.00	0.74
13	002716	湖南白银	1,922,330	15,551,649.70	0.74
14	001359	平安电工	123,860	15,513,465.00	0.74
15	603083	剑桥科技	60,400	15,394,148.00	0.73
16	000776	广发证券	650,600	15,224,040.00	0.72
17	600999	招商证券	712,900	15,042,190.00	0.71
18	603516	淳中科技	108,500	14,605,185.00	0.69
19	002517	恺英网络	898,000	14,592,500.00	0.69
20	603588	高能环境	756,748	14,529,561.60	0.69
21	603986	兆易创新	17,820	14,523,300.00	0.69
22	688110	东芯股份	70,200	14,299,740.00	0.68
23	002916	深南电路	30,800	14,103,320.00	0.67
24	000534	万泽股份	513,300	14,043,888.00	0.67
25	002328	新朋股份	1,908,600	14,009,124.00	0.67
26	601138	工业富联	190,000	13,708,500.00	0.65
27	600030	中信证券	467,146	13,421,104.58	0.64
28	002969	嘉美包装	950,300	13,380,224.00	0.64
29	300416	苏试试验	656,000	13,369,280.00	0.64
30	002643	万润股份	633,600	13,273,920.00	0.63
31	603228	景旺电子	182,000	13,178,620.00	0.63
32	688378	奥来德	211,752	13,128,624.00	0.62
33	300373	扬杰科技	82,454	12,964,242.42	0.62
34	688353	华盛锂电	111,400	12,930,198.00	0.61
35	000657	中钨高新	134,765	12,899,705.80	0.61
36	300164	通源石油	1,594,100	12,752,800.00	0.61
37	301150	中一科技	201,040	12,687,634.40	0.60
38	301369	联动科技	51,205	12,545,225.00	0.60
39	300129	泰胜风能	1,446,500	12,367,575.00	0.59
40	002938	鹏鼎控股	117,200	12,350,536.00	0.59
41	002636	金安国纪	102,000	12,236,940.00	0.58

42	300102	乾照光电	465,100	12,111,204.00	0.58
43	301086	鸿富瀚	57,686	12,072,526.08	0.57
44	300548	长芯博创	42,700	11,870,600.00	0.56
45	600601	方正科技	844,114	11,682,537.76	0.56
46	002600	领益智造	667,308	11,571,120.72	0.55
47	002080	中材科技	126,557	11,390,130.00	0.54
48	688766	普冉股份	14,600	11,192,360.00	0.53
49	688531	日联科技	62,800	11,168,352.00	0.53
50	002534	西子洁能	595,000	11,037,250.00	0.52
51	301200	大族数控	29,500	10,639,175.00	0.51
52	002415	海康威视	310,400	10,615,680.00	0.50
53	688347	华虹宏力	31,000	10,425,300.00	0.50
54	001339	智微智能	101,180	10,348,690.40	0.49
55	301308	江波龙	14,658	10,316,300.40	0.49
56	000426	兴业银锡	305,700	10,075,872.00	0.48
57	300870	欧陆通	29,000	10,025,010.00	0.48
58	000949	新乡化纤	1,578,000	10,004,520.00	0.48
59	300803	指南针	106,117	9,727,745.39	0.46
60	300758	七彩化学	759,600	9,532,980.00	0.45
61	002156	通富微电	118,300	8,975,421.00	0.43
62	300054	鼎龙股份	82,800	8,774,316.00	0.42
63	601208	东材科技	123,700	8,756,723.00	0.42
64	688239	航宇科技	146,200	8,747,146.00	0.42
65	600739	辽宁成大	862,300	8,717,853.00	0.41
66	605196	华通线缆	330,300	8,620,830.00	0.41
67	002222	福晶科技	92,400	8,526,672.00	0.41
68	300450	先导智能	208,100	8,473,832.00	0.40
69	688358	祥生医疗	274,835	8,401,705.95	0.40
70	300400	劲拓股份	220,500	8,301,825.00	0.39
71	603993	洛阳钼业	472,600	8,294,130.00	0.39
72	688525	佰维存储	16,600	8,212,518.00	0.39

73	002049	紫光国微	91,285	8,101,543.75	0.38
74	688120	华海清科	25,000	8,054,500.00	0.38
75	300760	迈瑞医疗	58,200	7,905,306.00	0.38
76	300905	宝丽迪	155,900	7,888,540.00	0.37
77	300322	硕贝德	307,200	7,741,440.00	0.37
78	000506	招金黄金	638,800	7,486,736.00	0.36
79	002478	常宝股份	1,204,900	7,446,282.00	0.35
80	688516	奥特维	129,000	7,403,310.00	0.35
81	002008	大族激光	49,200	7,385,412.00	0.35
82	605289	罗曼股份	50,620	7,339,900.00	0.35
83	000703	恒逸石化	535,500	7,266,735.00	0.35
84	688235	百济神州	28,379	7,225,577.19	0.34
85	002792	通宇通讯	200,600	7,135,342.00	0.34
86	603061	金海通	13,900	6,980,858.00	0.33
87	688159	有方科技	155,800	6,915,962.00	0.33
88	300988	津荣天宇	441,195	6,895,877.85	0.33
89	002397	梦洁股份	1,766,300	6,747,266.00	0.32
90	603893	瑞芯微	35,300	6,649,108.00	0.32
91	600816	建元信托	2,722,800	6,643,632.00	0.32
92	600546	山煤国际	590,300	6,451,979.00	0.31
93	688388	嘉元科技	144,320	6,350,080.00	0.30
94	002432	九安医疗	89,800	6,347,064.00	0.30
95	603790	雅运股份	297,400	6,346,516.00	0.30
96	002662	峰璟股份	1,683,900	6,230,430.00	0.30
97	300681	英搏尔	214,300	6,133,266.00	0.29
98	300223	北京君正	24,600	6,122,940.00	0.29
99	000969	安泰科技	248,800	6,105,552.00	0.29
100	688266	泽璟制药	51,385	5,994,574.10	0.28
101	600875	东方电气	207,200	5,961,144.00	0.28
102	600115	中国东航	1,554,900	5,924,169.00	0.28
103	300843	胜蓝股份	37,800	5,906,250.00	0.28

104	300986	志特新材	343,900	5,897,885.00	0.28
105	002676	顺威股份	1,180,100	5,876,898.00	0.28
106	688677	海泰新光	58,000	5,865,540.00	0.28
107	603489	八方股份	209,300	5,852,028.00	0.28
108	300638	广和通	314,200	5,815,842.00	0.28
109	002645	华宏科技	210,780	5,798,557.80	0.28
110	688717	艾罗能源	70,000	5,779,900.00	0.27
111	603019	中科曙光	53,900	5,779,697.00	0.27
112	301093	华兰股份	42,600	5,777,838.00	0.27
113	300136	信维通信	48,400	5,771,700.00	0.27
114	002998	优彩资源	877,000	5,709,270.00	0.27
115	301397	溯联股份	175,100	5,666,236.00	0.27
116	000811	冰轮环境	100,500	5,650,110.00	0.27
117	688639	华恒生物	337,600	5,448,864.00	0.26
118	603799	华友钴业	112,800	5,443,728.00	0.26
119	301165	锐捷网络	67,580	5,436,811.00	0.26
120	603217	元利科技	237,240	5,321,293.20	0.25
121	688221	前沿生物	235,800	5,281,920.00	0.25
122	688256	寒武纪	3,282	5,236,595.10	0.25
123	002475	立讯精密	73,100	5,146,240.00	0.24
124	002338	奥普光电	89,952	5,145,254.40	0.24
125	601869	长飞光纤	9,300	5,076,870.00	0.24
126	003020	立方制药	342,000	5,065,020.00	0.24
127	301081	严牌股份	367,600	5,028,768.00	0.24
128	300839	博汇股份	426,700	4,996,657.00	0.24
129	000987	越秀资本	634,700	4,963,354.00	0.24
130	600590	泰豪科技	487,500	4,923,750.00	0.23
131	002648	卫星化学	207,300	4,869,477.00	0.23
132	300502	新易盛	8,000	4,856,000.00	0.23
133	002001	新 和 成	169,600	4,820,032.00	0.23
134	600105	永鼎股份	70,600	4,764,088.00	0.23

135	603798	康普顿	346,060	4,734,100.80	0.22
136	603897	长城科技	144,500	4,690,470.00	0.22
137	300456	赛微电子	109,400	4,646,218.00	0.22
138	600176	中国巨石	63,000	4,591,440.00	0.22
139	300063	天龙集团	524,700	4,554,396.00	0.22
140	000733	振华科技	80,400	4,553,856.00	0.22
141	301316	慧博云通	113,500	4,469,630.00	0.21
142	000408	藏格矿业	63,700	4,415,684.00	0.21
143	002979	雷赛智能	77,700	4,334,106.00	0.21
144	300458	全志科技	108,466	4,280,068.36	0.20
145	000783	长江证券	434,900	4,240,275.00	0.20
146	605117	德业股份	39,720	4,217,469.60	0.20
147	601872	招商轮船	239,100	4,200,987.00	0.20
148	600938	中国海油	154,500	4,194,675.00	0.20
149	301003	江苏博云	77,900	4,167,650.00	0.20
150	603929	亚翔集成	15,200	4,134,704.00	0.20
151	601988	中国银行	721,900	4,129,268.00	0.20
152	000960	锡业股份	95,600	4,081,164.00	0.19
153	688148	芳源股份	452,000	3,878,160.00	0.18
154	002918	蒙娜丽莎	384,600	3,865,230.00	0.18
155	000565	渝三峡 A	669,800	3,804,464.00	0.18
156	300864	南大环境	194,858	3,737,376.44	0.18
157	002297	博云新材	128,800	3,733,912.00	0.18
158	688981	中芯国际	23,400	3,716,388.00	0.18
159	600460	士兰微	66,700	3,645,822.00	0.17
160	300154	瑞凌股份	482,900	3,631,408.00	0.17
161	600549	厦门钨业	42,600	3,629,520.00	0.17
162	002975	博杰股份	25,350	3,599,700.00	0.17
163	600251	冠农股份	416,600	3,599,424.00	0.17
164	002990	盛视科技	45,300	3,578,700.00	0.17
165	600309	万华化学	51,500	3,523,115.00	0.17

166	603067	振华股份	75,800	3,508,782.00	0.17
167	301056	森赫股份	307,200	3,440,640.00	0.16
168	300059	东方财富	168,400	3,431,992.00	0.16
169	002708	光洋股份	259,900	3,428,081.00	0.16
170	300602	飞荣达	65,400	3,348,480.00	0.16
171	688010	福光股份	68,800	3,345,744.00	0.16
172	300254	仟源医药	416,800	3,338,568.00	0.16
173	300017	网宿科技	255,900	3,329,259.00	0.16
174	002558	巨人网络	120,241	3,313,841.96	0.16
175	300623	捷捷微电	73,500	3,306,765.00	0.16
176	300286	安科瑞	135,900	3,281,985.00	0.16
177	301219	腾远钴业	59,630	3,267,724.00	0.16
178	002064	华峰化学	337,600	3,203,824.00	0.15
179	002947	恒铭达	41,800	3,178,890.00	0.15
180	301127	武汉天源	152,800	3,166,016.00	0.15
181	300279	和晶科技	517,000	3,127,850.00	0.15
182	002396	星网锐捷	162,410	3,113,399.70	0.15
183	002402	和而泰	119,575	3,088,622.25	0.15
184	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.15
185	300239	东宝生物	574,900	3,064,217.00	0.15
186	600487	亨通光电	28,000	3,061,520.00	0.15
187	605318	法狮龙	27,100	3,058,506.00	0.15
188	002025	航天电器	39,700	3,025,934.00	0.14
189	688025	杰普特	6,400	3,008,000.00	0.14
190	600226	亨通股份	309,300	2,966,187.00	0.14
191	002943	宇晶股份	67,020	2,964,294.60	0.14
192	300590	移为通信	205,900	2,954,665.00	0.14
193	300666	江丰电子	8,000	2,948,800.00	0.14
194	605123	派克新材	30,300	2,939,403.00	0.14
195	301039	中集车辆	413,500	2,915,175.00	0.14
196	688523	航天环宇	54,800	2,871,520.00	0.14

197	300014	亿纬锂能	44,100	2,867,823.00	0.14
198	601231	环旭电子	88,400	2,864,160.00	0.14
199	688361	中科飞测	6,600	2,838,000.00	0.13
200	600299	安迪苏	356,000	2,794,600.00	0.13
201	688301	奕瑞科技	22,400	2,777,600.00	0.13
202	300058	蓝色光标	198,900	2,736,864.00	0.13
203	688503	聚和材料	20,400	2,707,080.00	0.13
204	688571	杭华股份	306,198	2,679,232.50	0.13
205	002788	鹭燕医药	266,800	2,676,004.00	0.13
206	301529	福赛科技	27,700	2,669,172.00	0.13
207	000600	建投能源	303,900	2,659,125.00	0.13
208	600547	山东黄金	114,600	2,646,114.00	0.13
209	000923	河钢资源	211,300	2,622,233.00	0.12
210	001203	大中矿业	87,400	2,617,630.00	0.12
211	603920	世运电路	53,900	2,589,356.00	0.12
212	688002	睿创微纳	16,712	2,585,179.28	0.12
213	300775	三角防务	116,400	2,565,456.00	0.12
214	002841	视源股份	74,100	2,558,673.00	0.12
215	688668	鼎通科技	6,800	2,538,440.00	0.12
216	300277	汽轮科技	167,100	2,513,184.00	0.12
217	301021	英诺激光	20,200	2,462,380.00	0.12
218	000901	航天科技	138,400	2,462,136.00	0.12
219	601606	长城军工	89,100	2,449,359.00	0.12
220	002859	洁美科技	22,203	2,431,450.53	0.12
221	601600	中国铝业	292,800	2,406,816.00	0.11
222	688593	新相微	61,800	2,405,256.00	0.11
223	300473	德尔股份	78,500	2,386,400.00	0.11
224	603186	华正新材	10,500	2,365,650.00	0.11
225	002379	宏桥控股	158,800	2,345,476.00	0.11
226	300139	晓程科技	62,300	2,277,065.00	0.11
227	300109	新开源	141,800	2,275,890.00	0.11

228	301222	浙江恒威	74,700	2,238,012.00	0.11
229	000977	浪潮信息	31,800	2,226,000.00	0.11
230	605138	盛泰集团	399,700	2,206,344.00	0.10
231	301360	荣旗科技	32,200	2,205,378.00	0.10
232	300752	隆利科技	163,220	2,198,573.40	0.10
233	000001	平安银行	214,700	2,157,735.00	0.10
234	300461	田中精机	57,600	2,133,504.00	0.10
235	301122	采纳股份	72,000	2,117,520.00	0.10
236	603296	华勤技术	28,480	2,115,209.60	0.10
237	600903	贵州燃气	318,100	2,112,184.00	0.10
238	601211	国泰海通	114,500	2,083,900.00	0.10
239	300584	海辰药业	57,300	2,075,979.00	0.10
240	003018	金富科技	26,700	2,035,341.00	0.10
241	600502	安徽建工	467,800	2,034,930.00	0.10
242	000425	徐工机械	247,400	2,001,466.00	0.10
243	688536	思瑞浦	5,400	1,966,086.00	0.09
244	300881	盛德鑫泰	52,400	1,962,380.00	0.09
245	000576	甘化科工	297,400	1,953,918.00	0.09
246	300661	圣邦股份	13,600	1,951,328.00	0.09
247	688400	凌云光	29,379	1,944,889.80	0.09
248	603115	海星股份	15,700	1,922,779.00	0.09
249	002259	升达林业	500,100	1,895,379.00	0.09
250	002236	大华股份	114,300	1,884,807.00	0.09
251	300335	迪森股份	386,500	1,882,255.00	0.09
252	601995	中金公司	52,000	1,879,800.00	0.09
253	300592	华凯易佰	104,900	1,856,730.00	0.09
254	600028	中国石化	411,800	1,836,628.00	0.09
255	300432	富临精工	91,400	1,836,226.00	0.09
256	300408	三环集团	11,000	1,835,900.00	0.09
257	002271	东方雨虹	154,000	1,827,980.00	0.09
258	300248	新开普	236,900	1,826,499.00	0.09

259	002922	伊戈尔	55,600	1,823,680.00	0.09
260	002283	天润工业	186,300	1,797,795.00	0.09
261	600742	富维股份	248,000	1,795,520.00	0.09
262	300442	润泽科技	21,600	1,794,312.00	0.09
263	002498	汉缆股份	257,100	1,753,422.00	0.08
264	300401	花园生物	79,500	1,740,255.00	0.08
265	603739	蔚蓝生物	150,000	1,729,500.00	0.08
266	300774	倍杰特	159,400	1,713,550.00	0.08
267	300919	中伟新材	39,100	1,710,625.00	0.08
268	000531	穗恒运 A	284,200	1,702,358.00	0.08
269	688586	江航装备	144,675	1,691,250.75	0.08
270	603124	江南新材	9,000	1,682,820.00	0.08
271	300049	福瑞医科	43,200	1,679,616.00	0.08
272	300033	同花顺	6,800	1,638,800.00	0.08
273	002120	韵达股份	254,300	1,617,348.00	0.08
274	601108	财通证券	185,600	1,605,440.00	0.08
275	300004	南风股份	157,700	1,592,770.00	0.08
276	688275	万润新能	12,379	1,578,941.45	0.08
277	603032	德新科技	58,400	1,570,960.00	0.07
278	002134	天津普林	51,300	1,560,546.00	0.07
279	600392	盛和资源	52,100	1,551,017.00	0.07
280	300942	易瑞生物	265,799	1,536,318.22	0.07
281	300703	创源股份	119,600	1,527,292.00	0.07
282	600036	招商银行	42,900	1,522,950.00	0.07
283	300438	鹏辉能源	18,300	1,516,155.00	0.07
284	603933	睿能科技	66,600	1,501,830.00	0.07
285	002545	东方铁塔	91,300	1,480,886.00	0.07
286	688001	华兴源创	16,400	1,405,480.00	0.07
287	300115	长盈精密	49,700	1,388,618.00	0.07
288	603309	维力医疗	123,200	1,382,304.00	0.07
289	002655	共达电声	29,300	1,347,800.00	0.06

290	601088	中国神华	34,500	1,346,880.00	0.06
291	300920	润阳科技	38,600	1,333,630.00	0.06
292	000533	顺钠股份	140,200	1,333,302.00	0.06
293	300952	恒辉安防	76,400	1,329,360.00	0.06
294	603680	今创集团	134,900	1,323,369.00	0.06
295	000034	神州数码	47,406	1,315,516.50	0.06
296	688195	腾景科技	6,800	1,309,544.00	0.06
297	301662	宏工科技	12,685	1,285,244.20	0.06
298	300395	菲利华	9,600	1,283,808.00	0.06
299	301329	信音电子	52,300	1,270,367.00	0.06
300	688252	天德钰	52,800	1,267,200.00	0.06
301	688720	艾森股份	12,520	1,264,520.00	0.06
302	688041	海光信息	3,400	1,259,020.00	0.06
303	002412	汉森制药	227,400	1,250,700.00	0.06
304	001360	南矿集团	70,700	1,250,683.00	0.06
305	002228	合兴包装	422,200	1,241,268.00	0.06
306	300487	蓝晓科技	21,000	1,235,850.00	0.06
307	001376	百通能源	118,800	1,235,520.00	0.06
308	301025	读客文化	158,400	1,229,184.00	0.06
309	002028	思源电气	7,100	1,228,300.00	0.06
310	002166	莱茵生物	195,300	1,226,484.00	0.06
311	000810	创维数字	92,000	1,219,000.00	0.06
312	002582	好想你	143,300	1,210,885.00	0.06
313	603306	华懋科技	11,600	1,202,804.00	0.06
314	600690	海尔智家	58,800	1,200,108.00	0.06
315	600790	轻纺城	365,100	1,193,877.00	0.06
316	002602	世纪华通	83,700	1,180,170.00	0.06
317	601918	新集能源	136,800	1,175,112.00	0.06
318	601998	中信银行	168,100	1,164,933.00	0.06
319	002970	锐明技术	21,800	1,164,774.00	0.06
320	000333	美的集团	15,300	1,155,609.00	0.05

321	300342	天银机电	24,500	1,151,500.00	0.05
322	300979	华利集团	38,500	1,145,375.00	0.05
323	688518	联赢激光	36,200	1,118,580.00	0.05
324	002960	青鸟智控	131,400	1,112,958.00	0.05
325	600879	航天电子	51,700	1,100,693.00	0.05
326	600219	南山铝业	274,700	1,096,053.00	0.05
327	002057	中钢天源	87,700	1,090,111.00	0.05
328	300275	梅安森	134,300	1,078,429.00	0.05
329	603889	新澳股份	210,430	1,075,297.30	0.05
330	002380	科远智慧	31,200	1,066,416.00	0.05
331	300750	宁德时代	2,700	1,061,127.00	0.05
332	688018	乐鑫科技	8,240	1,054,060.80	0.05
333	003019	宸展光电	32,100	1,044,855.00	0.05
334	301196	唯科科技	8,230	1,032,206.60	0.05
335	000786	北新建材	56,600	1,023,894.00	0.05
336	002756	永兴材料	17,700	1,002,528.00	0.05
337	002540	亚太科技	211,500	987,705.00	0.05
338	002241	歌尔股份	43,600	982,308.00	0.05
339	001313	粤海饲料	138,200	979,838.00	0.05
340	688697	纽威数控	71,600	973,044.00	0.05
341	000623	吉林敖东	54,400	964,512.00	0.05
342	300191	潜能恒信	34,500	953,925.00	0.05
343	002404	嘉欣丝绸	164,900	943,228.00	0.04
344	301057	汇隆新材	40,900	940,700.00	0.04
345	600361	创新新材	260,600	938,160.00	0.04
346	002429	兆驰股份	90,000	935,100.00	0.04
347	600276	恒瑞医药	17,900	931,516.00	0.04
348	603283	赛腾股份	11,400	923,172.00	0.04
349	603126	中材节能	144,700	911,610.00	0.04
350	002256	兆新股份	249,700	906,411.00	0.04
351	603505	金石资源	44,900	904,735.00	0.04

352	300628	亿联网络	26,300	889,466.00	0.04
353	300664	鹏鹞环保	209,050	886,372.00	0.04
354	000060	中金岭南	114,400	866,008.00	0.04
355	002706	良信股份	78,900	860,799.00	0.04
356	601628	中国人寿	24,300	859,005.00	0.04
357	600232	金鹰股份	136,200	858,060.00	0.04
358	300354	东华测试	25,100	850,388.00	0.04
359	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.04
360	300215	电科院	126,400	832,976.00	0.04
361	601127	赛力斯	13,300	814,625.00	0.04
362	002203	海亮股份	35,300	806,605.00	0.04
363	601101	昊华能源	75,500	797,280.00	0.04
364	301396	宏景科技	2,400	795,840.00	0.04
365	688183	生益电子	6,000	794,400.00	0.04
366	600031	三一重工	45,900	793,152.00	0.04
367	002294	信立泰	24,800	790,872.00	0.04
368	300199	翰宇药业	35,800	790,464.00	0.04
369	601166	兴业银行	47,600	788,256.00	0.04
370	300654	世纪天鸿	80,900	786,348.00	0.04
371	002824	和胜股份	22,700	784,966.00	0.04
372	601061	中信金属	72,800	784,056.00	0.04
373	002476	新叶股份	161,300	783,918.00	0.04
374	688510	航亚科技	32,800	783,264.00	0.04
375	000036	华联控股	179,100	782,667.00	0.04
376	301367	瑞迈特	20,100	777,066.00	0.04
377	000975	山金国际	45,600	775,200.00	0.04
378	300715	凯伦股份	46,900	771,974.00	0.04
379	300855	图南股份	24,500	765,870.00	0.04
380	000021	深科技	11,800	758,386.00	0.04
381	300990	同飞股份	7,200	756,504.00	0.04
382	600356	恒丰纸业	101,900	755,079.00	0.04

383	600727	鲁北化工	111,700	750,624.00	0.04
384	688012	中微公司	1,600	749,600.00	0.04
385	603259	药明康德	6,000	747,060.00	0.04
386	603320	迪贝电气	42,700	745,115.00	0.04
387	301358	湖南裕能	9,800	743,526.00	0.04
388	300606	金太阳	17,300	736,288.00	0.03
389	600267	海正药业	72,200	729,942.00	0.03
390	000683	博源化工	125,900	725,184.00	0.03
391	001208	华菱线缆	50,900	722,271.00	0.03
392	600583	海油工程	143,000	719,290.00	0.03
393	002130	沃尔核材	37,500	711,000.00	0.03
394	688580	伟思医疗	13,200	703,164.00	0.03
395	603160	汇顶科技	11,300	697,323.00	0.03
396	301283	聚胶股份	28,435	696,088.80	0.03
397	002409	雅克科技	3,100	695,950.00	0.03
398	300987	川网传媒	56,408	693,818.40	0.03
399	600348	华阳股份	89,100	681,615.00	0.03
400	002250	联化科技	49,800	680,766.00	0.03
401	300491	通合科技	17,800	679,782.00	0.03
402	301305	朗坤科技	23,800	678,776.00	0.03
403	300953	震裕科技	5,020	671,174.00	0.03
404	301016	雷尔伟	47,600	664,972.00	0.03
405	300236	上海新阳	5,000	657,500.00	0.03
406	601288	农业银行	107,200	650,704.00	0.03
407	002245	蔚蓝锂芯	34,200	639,882.00	0.03
408	002683	广东宏大	21,800	638,522.00	0.03
409	601865	福莱特	60,200	632,702.00	0.03
410	000570	苏常柴A	134,300	627,181.00	0.03
411	300124	汇川技术	9,400	623,502.00	0.03
412	688390	固德威	5,687	617,096.37	0.03
413	300339	润和软件	16,007	616,429.57	0.03

414	002395	双象股份	51,200	612,352.00	0.03
415	600796	钱江生化	131,900	612,016.00	0.03
416	601377	兴业证券	101,200	611,248.00	0.03
417	000962	东方钨业	6,700	607,020.00	0.03
418	688508	芯朋微	6,400	594,944.00	0.03
419	000932	华菱钢铁	171,300	594,411.00	0.03
420	300413	芒果超媒	40,300	589,589.00	0.03
421	000950	重药控股	113,200	567,132.00	0.03
422	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.03
423	300016	北陆药业	71,800	550,706.00	0.03
424	688579	地纬智能	71,400	541,926.00	0.03
425	301060	兰卫医学	66,200	540,854.00	0.03
426	300447	全信股份	34,100	509,113.00	0.02
427	600391	航发科技	15,200	508,440.00	0.02
428	301230	泓博医药	13,800	508,392.00	0.02
429	002942	新农股份	35,300	505,849.00	0.02
430	603871	嘉友国际	49,400	504,374.00	0.02
431	600941	中国移动	5,800	499,554.00	0.02
432	001270	铖昌科技	3,200	499,168.00	0.02
433	600482	中国动力	15,100	495,280.00	0.02
434	300916	朗特智能	20,800	486,096.00	0.02
435	000100	TCL科技	83,000	483,060.00	0.02
436	603093	南华期货	26,500	480,975.00	0.02
437	301190	善水科技	29,900	479,297.00	0.02
438	002352	顺丰控股	15,300	478,278.00	0.02
439	300567	精测电子	1,500	476,400.00	0.02
440	000166	申万宏源	106,600	469,040.00	0.02
441	002266	浙富控股	91,400	462,484.00	0.02
442	301626	苏州天脉	1,200	460,752.00	0.02
443	000419	通程控股	102,100	460,471.00	0.02
444	600196	复星医药	20,400	458,388.00	0.02

445	600660	福耀玻璃	9,000	453,960.00	0.02
446	002179	中航光电	9,800	452,760.00	0.02
447	003035	南网能源	77,200	449,304.00	0.02
448	000651	格力电器	11,900	446,250.00	0.02
449	300655	晶瑞电材	20,625	441,787.50	0.02
450	603696	安记食品	38,100	438,150.00	0.02
451	300222	科大智能	31,300	433,505.00	0.02
452	601601	中国太保	15,100	430,652.00	0.02
453	301172	君逸数码	16,200	420,390.00	0.02
454	601318	中国平安	8,800	420,112.00	0.02
455	002666	德联集团	106,100	419,095.00	0.02
456	300804	广康生化	13,400	418,884.00	0.02
457	300532	今天国际	67,100	418,033.00	0.02
458	600841	动力新科	68,100	415,410.00	0.02
459	688799	华纳药厂	9,200	412,804.00	0.02
460	300922	天秦装备	27,100	410,565.00	0.02
461	688475	萤石网络	15,000	410,250.00	0.02
462	688109	品茗科技	5,400	408,780.00	0.02
463	605287	德才股份	9,600	398,304.00	0.02
464	002736	国信证券	39,600	395,604.00	0.02
465	603663	三祥新材	4,100	394,830.00	0.02
466	301195	北路智控	14,400	390,240.00	0.02
467	002375	亚厦股份	112,900	381,602.00	0.02
468	002539	云图控股	33,500	379,220.00	0.02
469	002879	长缆科技	28,500	374,205.00	0.02
470	301183	东田微	1,400	370,818.00	0.02
471	002202	金风科技	15,500	370,450.00	0.02
472	001226	拓山重工	7,800	370,110.00	0.02
473	600801	华新建材	23,700	369,720.00	0.02
474	600570	恒生电子	17,400	368,706.00	0.02
475	000933	神火股份	17,200	364,640.00	0.02

476	688618	三旺通信	11,800	363,086.00	0.02
477	002837	英维克	4,545	361,600.20	0.02
478	002284	亚太股份	37,800	358,722.00	0.02
479	002787	华源控股	11,100	357,420.00	0.02
480	002945	华林证券	26,300	353,209.00	0.02
481	600489	中金黄金	19,300	348,365.00	0.02
482	601699	潞安环能	24,200	345,576.00	0.02
483	000990	诚志股份	42,100	344,378.00	0.02
484	600435	北方导航	30,600	342,720.00	0.02
485	601398	工商银行	48,200	340,774.00	0.02
486	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.02
487	600362	江西铜业	7,800	337,740.00	0.02
488	002625	光启技术	11,100	336,552.00	0.02
489	300908	仲景食品	15,000	330,600.00	0.02
490	688656	浩欧博	3,400	329,018.00	0.02
491	001228	永泰运	12,800	327,040.00	0.02
492	001965	招商公路	35,600	326,096.00	0.02
493	300132	青松股份	57,200	324,896.00	0.02
494	002632	道明光学	35,900	323,459.00	0.02
495	688231	隆达股份	8,800	323,224.00	0.02
496	300711	广哈通信	19,500	319,800.00	0.02
497	600098	广州发展	54,000	319,140.00	0.02
498	301129	瑞纳智能	15,200	317,224.00	0.02
499	688309	恒誉环保	5,200	316,576.00	0.02
500	000919	金陵药业	54,300	316,569.00	0.02
501	002980	华盛昌	2,700	314,658.00	0.01
502	600558	大西洋	63,400	313,196.00	0.01
503	300476	胜宏科技	900	311,787.00	0.01
504	603305	旭升集团	25,600	310,272.00	0.01
505	002012	凯恩股份	47,900	307,039.00	0.01
506	601168	西部矿业	11,300	306,682.00	0.01

507	002564	天沃科技	71,200	306,160.00	0.01
508	603600	永艺股份	34,500	306,015.00	0.01
509	301106	骏成科技	14,600	302,804.00	0.01
510	605133	嵘泰股份	7,650	301,180.50	0.01
511	688608	恒玄科技	1,800	300,942.00	0.01
512	002389	航天彩虹	16,900	300,313.00	0.01
513	000878	云南铜业	18,700	296,956.00	0.01
514	688108	赛诺医疗	16,000	296,480.00	0.01
515	600150	中国船舶	8,713	294,412.27	0.01
516	301148	嘉戎技术	5,500	292,930.00	0.01
517	603507	振江股份	8,900	292,721.00	0.01
518	688006	杭可科技	8,000	292,400.00	0.01
519	603206	嘉环科技	18,200	289,926.00	0.01
520	600710	苏美达	29,900	285,844.00	0.01
521	301120	新特电气	17,100	284,373.00	0.01
522	601233	桐昆股份	12,800	277,120.00	0.01
523	300101	振芯科技	16,900	273,273.00	0.01
524	688371	菲沃泰	7,000	272,930.00	0.01
525	002376	新北洋	47,300	271,975.00	0.01
526	603689	皖天然气	39,100	270,963.00	0.01
527	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.01
528	300677	英科医疗	6,800	266,356.00	0.01
529	605080	浙江自然	13,700	263,862.00	0.01
530	603380	易德龙	5,800	261,522.00	0.01
531	600967	内蒙一机	24,100	261,485.00	0.01
532	002833	弘亚数控	13,500	260,415.00	0.01
533	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
534	300285	国瓷材料	2,500	257,950.00	0.01
535	300409	道氏技术	12,900	257,097.00	0.01
536	300939	秋田微	3,700	256,040.00	0.01
537	600886	国投电力	19,200	255,552.00	0.01

538	603299	苏盐井神	29,000	254,910.00	0.01
539	301238	瑞泰新材	10,400	253,760.00	0.01
540	600613	神奇制药	57,100	253,524.00	0.01
541	002242	九阳股份	32,100	252,306.00	0.01
542	600346	恒力石化	14,200	251,482.00	0.01
543	603197	保隆科技	9,000	251,460.00	0.01
544	301136	招标股份	22,800	250,344.00	0.01
545	688162	巨一科技	10,556	249,543.84	0.01
546	300856	科思股份	23,300	248,378.00	0.01
547	002594	比亚迪	3,100	247,070.00	0.01
548	601899	紫金矿业	9,800	246,372.00	0.01
549	300896	爱美客	2,800	244,160.00	0.01
550	000688	国城矿业	7,100	243,033.00	0.01
551	001358	兴欣新材	9,400	242,896.00	0.01
552	000554	泰山石油	43,200	242,352.00	0.01
553	002738	中矿资源	4,100	241,859.00	0.01
554	600893	航发动力	6,300	241,542.00	0.01
555	000981	山子高科	83,700	241,056.00	0.01
556	003001	中岩大地	18,600	240,870.00	0.01
557	600809	山西汾酒	2,200	240,614.00	0.01
558	300218	安利股份	20,200	240,380.00	0.01
559	600731	湖南海利	46,500	238,080.00	0.01
560	603970	中农立华	24,700	237,861.00	0.01
561	600666	奥瑞德	59,400	235,818.00	0.01
562	300233	金城医药	19,000	235,600.00	0.01
563	603759	海天股份	34,200	235,296.00	0.01
564	301487	盟固利	12,200	233,630.00	0.01
565	300292	吴通控股	43,100	233,602.00	0.01
566	600019	宝钢股份	42,600	231,318.00	0.01
567	000895	双汇发展	10,100	226,240.00	0.01
568	603626	科森科技	12,000	222,000.00	0.01

569	600926	杭州银行	14,800	213,860.00	0.01
570	002081	金螳螂	48,400	209,572.00	0.01
571	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
572	002931	锋龙股份	2,100	144,858.00	0.01
573	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
574	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
575	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
576	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
577	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
578	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
579	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
580	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
581	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
582	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
583	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
584	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
585	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
586	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
587	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
588	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
589	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
590	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
591	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
592	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
593	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
594	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
595	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
596	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
597	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
598	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
599	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00

600	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
601	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
602	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	300857	协创数据	83,856,610.35	5.26
2	000426	兴业银锡	77,973,909.00	4.89
3	000657	中钨高新	74,671,066.85	4.68
4	301308	江波龙	73,035,795.67	4.58
5	002008	大族激光	70,776,588.00	4.44
6	002281	光迅科技	68,498,973.00	4.30
7	002851	麦格米特	65,030,772.67	4.08
8	688525	佰维存储	62,704,775.08	3.93
9	300604	长川科技	59,752,450.45	3.75
10	002558	巨人网络	59,512,851.75	3.73
11	300450	先导智能	59,353,475.00	3.72
12	688766	普冉股份	56,039,072.47	3.52
13	002222	福晶科技	55,907,631.60	3.51
14	301358	湖南裕能	55,206,007.60	3.46
15	600549	厦门钨业	50,081,306.00	3.14
16	001309	德明利	49,256,475.30	3.09
17	603588	高能环境	48,700,655.56	3.06
18	600487	亨通光电	46,308,313.00	2.91
19	002155	湖南黄金	45,749,410.20	2.87
20	688531	日联科技	45,743,803.20	2.87
21	688375	国博电子	45,618,462.63	2.86

22	301377	鼎泰高科	45,344,860.00	2.84
23	002402	和而泰	44,554,623.66	2.80
24	600601	方正科技	42,988,805.88	2.70
25	601615	明阳智能	42,779,711.39	2.68
26	002738	中矿资源	42,293,952.68	2.65
27	002517	恺英网络	40,245,714.00	2.52
28	603920	世运电路	40,165,552.32	2.52
29	601869	长飞光纤	39,674,657.88	2.49
30	603516	淳中科技	39,138,325.00	2.46
31	688390	固德威	38,047,248.99	2.39
32	002716	湖南白银	37,879,165.50	2.38
33	301316	慧博云通	37,810,921.71	2.37
34	300806	斯迪克	37,119,718.00	2.33
35	605376	博迁新材	37,074,195.00	2.33
36	300373	扬杰科技	36,789,235.68	2.31
37	688002	睿创微纳	36,655,619.31	2.30
38	300073	当升科技	36,561,223.86	2.29
39	600150	中国船舶	36,418,626.16	2.28
40	002534	西子洁能	36,290,446.00	2.28
41	603986	兆易创新	35,883,508.40	2.25
42	300136	信维通信	35,702,322.40	2.24
43	002273	水晶光电	35,461,014.00	2.22
44	300014	亿纬锂能	34,749,955.00	2.18
45	300592	华凯易佰	34,592,474.00	2.17
46	300274	阳光电源	34,508,943.00	2.17
47	301095	广立微	34,349,273.00	2.16
48	300548	长芯博创	34,298,599.00	2.15
49	603256	宏和科技	34,086,550.00	2.14
50	301093	华兰股份	34,078,835.58	2.14
51	000603	盛达资源	33,894,675.00	2.13
52	600183	生益科技	33,520,707.00	2.10

53	603678	火炬电子	33,040,732.00	2.07
54	301626	苏州天脉	32,585,800.43	2.04
55	301219	腾远钴业	32,241,109.00	2.02

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	002008	大族激光	98,067,048.98	6.15
2	000657	中钨高新	86,565,987.72	5.43
3	000426	兴业银锡	82,333,466.51	5.17
4	301308	江波龙	78,886,516.24	4.95
5	300857	协创数据	72,106,934.40	4.52
6	600549	厦门钨业	65,758,821.00	4.13
7	002222	福晶科技	62,584,165.12	3.93
8	688525	佰维存储	61,139,952.00	3.84
9	002281	光迅科技	61,093,309.67	3.83
10	600487	亨通光电	60,695,516.79	3.81
11	002851	麦格米特	60,587,611.00	3.80
12	301358	湖南裕能	54,722,637.39	3.43
13	688766	普冉股份	54,632,275.88	3.43
14	300604	长川科技	54,413,620.00	3.41
15	002558	巨人网络	50,842,084.00	3.19
16	002402	和而泰	49,532,645.00	3.11
17	300806	斯迪克	48,500,327.00	3.04
18	300450	先导智能	48,003,194.40	3.01
19	688390	固德威	47,482,943.63	2.98
20	301316	慧博云通	46,296,242.57	2.90

21	603920	世运电路	45,915,834.82	2.88
22	688375	国博电子	45,687,620.49	2.87
23	601869	长飞光纤	44,457,821.80	2.79
24	603678	火炬电子	44,409,189.00	2.79
25	002155	湖南黄金	44,365,898.61	2.78
26	002273	水晶光电	44,100,775.00	2.77
27	603256	宏和科技	44,039,148.00	2.76
28	300014	亿纬锂能	43,532,832.60	2.73
29	688002	睿创微纳	43,477,914.34	2.73
30	688531	日联科技	42,565,102.89	2.67
31	002517	恺英网络	39,334,085.27	2.47
32	300274	阳光电源	38,829,600.00	2.44
33	603986	兆易创新	38,530,794.00	2.42
34	002738	中矿资源	38,367,696.32	2.41
35	300491	通合科技	38,241,495.00	2.40
36	601615	明阳智能	38,188,039.05	2.40
37	301095	广立微	38,077,140.72	2.39
38	605376	博迁新材	37,981,227.00	2.38
39	600183	生益科技	37,171,461.95	2.33
40	600150	中国船舶	37,052,604.04	2.32
41	301626	苏州天脉	36,995,401.50	2.32
42	600114	东睦股份	36,524,275.77	2.29
43	000603	盛达资源	36,420,715.60	2.29
44	601872	招商轮船	36,260,423.53	2.27
45	002378	章源钨业	35,903,954.41	2.25
46	600026	中远海能	35,495,893.00	2.23
47	603588	高能环境	35,314,330.00	2.22
48	300373	扬杰科技	34,086,064.48	2.14
49	603929	亚翔集成	33,786,763.50	2.12
50	603993	洛阳钼业	33,750,426.00	2.12
51	002475	立讯精密	33,584,450.00	2.11

52	601168	西部矿业	33,392,604.98	2.10
53	300454	深信服	33,134,267.95	2.08
54	688222	成都先导	32,913,880.52	2.06
55	603979	金诚信	32,675,962.48	2.05
56	600309	万华化学	32,568,818.36	2.04
57	688179	阿拉丁	32,419,011.82	2.03
58	300654	世纪天鸿	32,149,358.00	2.02
59	603045	福达合金	31,932,987.00	2.00

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	14,306,404,707.41
卖出股票收入（成交）总额	14,209,775,132.93

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	105,290,790.22	5.00
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	105,290,790.22	5.00

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	019827	26国债01	659,000	66,327,158.38	3.15
2	019792	25国债19	302,000	30,516,868.33	1.45
3	019835	26国债09	54,000	5,408,887.07	0.26
4	019785	25国债13	30,000	3,037,876.44	0.14

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 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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约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	4,494,324.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,494,324.94

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 伍佰 智航A	4,262	62,348.68	145,180,671.75	54.63%	120,549,399.22	45.37%
博道	13,	53,128.37	344,319,892.38	48.5	364,943,815.38	51.45%

伍佰智航C	350			5%		
合计	17,288	56,397.14	489,500,564.13	50.21%	485,493,214.60	49.79%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025年07月01日-2026年06月30日）
盈利投资者数量占比	89.48%

8.3 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	博道伍佰智航A	672,276.80	0.25%
	博道伍佰智航C	428,120.25	0.06%
	合计	1,100,397.05	0.11%

8.4 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	博道伍佰智航A	0~10
	博道伍佰智航C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	博道伍佰智航A	0~10
	博道伍佰智航C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道伍佰智航A	博道伍佰智航C
基金合同生效日(2019年09月26)	274,561,475.68	483,890,618.24

日)基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	209,466,431.28	697,042,086.31
本报告期基金总申购份额	191,751,134.56	429,933,268.70
减：本报告期基金总赎回份额	135,487,494.87	417,711,647.25
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	265,730,070.97	709,263,707.76

注：

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。自本基金基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
浙商证券	2	28,512,464,453.42	100.00%	12,429,587.87	100.00%	-

10.7.2 基金租用或者通过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
浙商证券	163,717,218.38	100.00%	24,504,000.00	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，财务状况良好；
 - （2）具备良好的合规风控能力，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
 - （3）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；

(4) 具有较强的全方位金融服务及研究能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面。

3、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用提供证券交易服务的证券公司；
- (2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订相关协议。

4、报告期内，本基金已严格遵守证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2026-01-22
2	博道伍佰智航股票型证券投资基金2025年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-22
3	博道基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
4	博道基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2026-03-31
5	博道伍佰智航股票型证券投资基金2025年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
6	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	2026-04-22
7	博道伍佰智航股票型证券投资基金2026年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-22
8	2025年度博道基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-30

9	博道基金管理有限公司关于提醒客户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	2026-06-03
---	----------------------------------	--	------------

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道伍佰智航股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道伍佰智航股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道伍佰智航股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道伍佰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伍佰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、报告期内博道伍佰智航股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

11.3 查阅方式

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

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

博道基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日