

博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金

2022年第4季度报告

2022年12月31日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2023年01月20日

目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要财务指标	4
3.2 基金净值表现	5
§4 管理人报告	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	7
4.3 公平交易专项说明	7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	8
4.5 报告期内基金的业绩表现	9
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	10
§5 投资组合报告	10
5.1 报告期末基金资产组合情况	10
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	10
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细	11
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	12
5.5 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债券投资明细	12
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细	12
5.7 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	13
5.8 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权证投资明细	13
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	13
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	13
5.11 投资组合报告附注	13
§6 开放式基金份额变动	14
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	15
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	15
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	16
§8 备查文件目录	16
8.1 备查文件目录	16
8.2 存放地点	16
8.3 查阅方式	16

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年10月25日起至2022年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合
基金主代码	016637
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年10月25日
报告期末基金份额总额	221,557,911.94份
投资目标	在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金力争通过大类资产配置、在基金合同约定的投资比例范围内动态调整权益资产仓位来降低组合波动性，实现控制波动率的投资目标，从而提高基金资产风险调整后收益。正常市场环境中，本基金采用长期战略资产配置和中期战术资产配置相结合的方式，综合考虑各大类资产的波动率和各类宏观经济变量，判断周期所处的阶段，对固定收益类资产、权益类资产和现金等大类资产的配置比例进行动态调整。此外，通过细分经济场景构建防御因子，多维度监测市场的尾部异常风险，当预警可能出现尾部异常风险时降低风险资产的配置以防范净值出现大幅波动的风险。在债券投资方面，本基金债券投资策略主要包括类属配置策略、利率债策略、息

	差策略、可转换债券和可交换债券投资策略、信用债投资策略（含资产支持证券）等积极的投资策略。在股票投资方面，本基金遵循多因子选股思路，综合考虑基本面因子、动量因子、行为金融因子等，对个股的潜在投资价值进行综合评价，挑选评分较高的个股构建组合。同时，动态调整不同因子的配置权重，增强组合的风格适应性。此外，本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金将遵循上述股票投资策略，选择潜在投资价值较高的港股进行投资。本基金的股指期货投资策略、国债期货投资策略和存托凭证投资策略详见法律文件。	
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率×85%+沪深300指数收益率×13%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×2%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合A	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合C
下属分级基金的交易代码	016637	016638
报告期末下属分级基金的份额总额	141,182,103.68份	80,375,808.26份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2022年10月25日 - 2022年12月31日)	
	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合A	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合C
1. 本期已实现收益	61,327.75	-23,893.04

2. 本期利润	-639,370.69	-422,728.71
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0045	-0.0053
4. 期末基金资产净值	140,542,732.99	79,953,079.55
5. 期末基金份额净值	0.9955	0.9947

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、本基金合同生效日为2022年10月25日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满三个月。

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

博道和瑞多元稳健6个月持有期混合A净值表现

阶段	净值增长率①	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
自基金合同生效起至今	-0.45%	0.05%	0.61%	0.18%	-1.06%	-0.13%

博道和瑞多元稳健6个月持有期混合C净值表现

阶段	净值增长率①	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
自基金合同生效起至今	-0.53%	0.05%	0.61%	0.18%	-1.14%	-0.13%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

博道和瑞多元稳健6个月持有期混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年10月25日-2022年12月31日)



注：本基金基金合同生效日为2022年10月25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，本基金尚处于建仓期，且运作时间未满一年。

博道和瑞多元稳健6个月持有期混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年10月25日-2022年12月31日)



注：本基金基金合同生效日为2022年10月25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，本基金尚处于建仓期，且运作时间未满一年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈连权	博道盛利6个月持有期混合、博道和瑞多元稳健6个月持有期混合的基金经理、固定收益投资总监	2022-10-25	-	15年	陈连权先生，中国籍，经济学硕士。2007年8月至2015年5月担任交银施罗德基金管理有限公司投资研究部分析师、专户投资部副总经理，2015年5月至2017年11月担任富国基金管理有限公司固定收益研究部总经理、固定收益专户投资部总经理、固定收益投资总监兼基金经理，2018年2月至2021年12月担任上海远海资产管理有限公司副总经理、投资总监、研究总监。2021年12月加入博道基金管理有限公司，现任固定收益投资总监。具有基金从业资格。自2022年2月9日起担任博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金基金经理至今、自2022年10月25日起担任博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金基金经理至今。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，实现投资组合间公平交易分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

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

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现违反公平交易的行为。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度，国内政策调整，地产政策三支箭齐发，美联储加息预期也随通胀缓和而降温，A股市场的风险偏好因此脉冲回暖，而后又有所降温，债券市场亦同步反应。全季看，股票方面，沪深300上涨1.75%、中证500上涨2.63%，国证2000上涨4.25%，基金重仓指数上涨0.3%；债券方面，十年期美债利率上行5BP，而中国十年期国债上行7BP，人民币升值3.18%至6.92。

四季度的显著变化是A股与中债的风险偏好联袂回暖，政策拐点是直接的触发因素，展望2023年，可能最容易的方式是线性外推地认为：“2023年将是一个复苏年，股票上涨，利率低迷”，这虽然可能不会过度地偏离当前市场的主流预期，但结论却未必一定是正确的，为此，我们呈现以下几个客观事实。

首先，偏弱的基本面估计仍然是一个最大的客观事实。12月的PMI降至47，弱于季节性，也低于4月份的低点，而11月份百城房价上涨个数仍处于历史低位的22个，11月份房地产开发投资累计同比为-9.8%，则反映了仍偏弱的短周期景气，此外，影响中国

中性利率的中期融资需求也仍然偏弱，以上是影响短期货币政策以及长期利率中枢的两大因素。与此同时，11月美国PMI降至49，中国出口同比降至-8.9%，反映了外需对中国经济的压制正在路上，我们在此前季报中也有所阐述，贸易项的收窄也可能会从外部流动性的角度压制股票估值。

其次，政策在很大程度上影响着经济走势是另一个客观事实。政策调整会否必然带来经济的大拐点？我们认为，这是前提条件，而非充分必要条件，市场自发的消费复苏可能尚不足以彻底扭转经济，仍然需要一系列的政策对冲。

最后，需要辩证地看待短期复苏与长期中枢位置。站在当下展望2023年经济，一季度偏弱，二季度出现同比及环比上升，是一个基准预期，而上升力度在很大程度上取决于一季度的政策释放力度；但如果放眼三季度以上更长视角，则需要客观地看待更长期的经济中枢，因为从更长期角度看，未来中国经济更偏向是一个通缩体质，而非通胀体质，在地产与财政难以长期趋势扩张的前提之下，经济的融资需求曲线内缩，高息资产长期缺位，这是我们此前所认为的“利率将迎来战略性配置窗口”的立足点，换言之，疫后的经济复苏不是单面的、线性的复苏，即使在二季度经济如期反弹之时，利率可能却将是一个“第二次的配置窗口”，其根本原因仍然是中性利率的下移并没有被根本性地撼动。

另一方面，从通胀角度，随着海外经济体的降温，通胀开始出现缓和，无论通胀、利率、亦或是风险偏好，都是经济增长与流动性的不同镜像，而经济从来不是一个流线型的单面线性体，短期的预期、中期的可能、长期的中枢是需要被考察的三个方面，通胀亦是如此，正是因为中期经济开始出现衰退迹象，从而产生了短期的加息与通胀预期的放缓，但若放眼更长视角，海外通胀的长期粘性并未完全消失。事实上，我们预期，通胀在2023年上半年在经济下降之时将延续降温，但在下半年一旦美联储紧缩力度下降则可能卷土重来，尽管力度可能会低于过去。

本基金于2022年10月25日成立，尚处于建仓期，四季度中，我们本着稳健建仓的思路，以及股票与债券均衡配置的原则，债券方面，以高等级品种作为配置底仓，同时运用利率量化策略进行增强；股票方面，运用多因子模型捕捉股票超额收益，同时，根据债券所能提供的安全垫稳步动态地调整股票仓位。

综上，展望2023年，我们预期，政策拐点只是经济与市场转好的前提条件，风险偏好有望在一段时间里维持温暖，其能否持续的关键在于未来一个季度的实际执行力度。在压制中国A股中期估值的主要因素中，美联储紧缩放缓，贸易景气转弱，中期盈利周期尚未回摆，信贷脉冲仍然偏弱，如果一季度信贷能够中场发力，二季度盈利周期顺利上行，那么，A股可能迎来中期估值的向上拐点，反之则可能再次陷入震荡。而从资产配置角度，我们仍然建议维持股票与债券的均衡配置，以更好地适应非线性的经济变化。

本基金将继续坚持攻守兼备的投资思路，积极跟踪把握基本面与市场的变化，保持对市场的尊重及敬畏，秉持勤勉尽责，力争为投资者获得有竞争力的投资收益。

4.5 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。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	10,150,927.97	4.60
	其中：股票	10,150,927.97	4.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	160,389,222.62	72.65
	其中：债券	160,389,222.62	72.65
	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	43,017,916.72	19.49
	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	7,124,829.20	3.23
8	其他资产	90,216.00	0.04
9	合计	220,773,112.51	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	235,169.00	0.11
C	制造业	6,636,041.00	3.01

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	56,208.00	0.03
E	建筑业	188,435.00	0.09
F	批发和零售业	604,220.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	153,010.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	915,756.97	0.42
J	金融业	385,883.00	0.18
K	房地产业	219,645.00	0.10
L	租赁和商务服务业	41,842.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	464,509.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	178,161.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	72,048.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	10,150,927.97	4.60

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	100	172,700.00	0.08
2	002841	视源股份	2,900	171,216.00	0.08
3	600436	片仔癀	400	115,384.00	0.05
4	000596	古井贡酒	400	106,760.00	0.05
5	600559	老白干酒	3,700	101,861.00	0.05
6	300523	辰安科技	4,400	91,828.00	0.04

7	600073	上海梅林	11,400	90,630.00	0.04
8	300311	任子行	14,900	90,592.00	0.04
9	600694	大商股份	5,000	90,500.00	0.04
10	301060	兰卫医学	4,600	90,206.00	0.04

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	18,225,772.05	8.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	587,170.14	0.27
	其中：政策性金融债	587,170.14	0.27
4	企业债券	90,663,721.64	41.12
5	企业短期融资券	20,149,605.48	9.14
6	中期票据	10,064,621.92	4.56
7	可转债（可交换债）	839,433.42	0.38
8	同业存单	19,858,897.97	9.01
9	其他	-	-
10	合计	160,389,222.62	72.74

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	012282665	22青岛啤酒SCPO03	200,000	20,149,605.48	9.14
2	122737	12石油04	180,000	19,875,624.66	9.01
3	112203035	22农业银行CD035	200,000	19,858,897.97	9.01
4	152502	20厦轨02	100,000	10,303,745.21	4.67
5	188770	21南网03	100,000	10,206,618.08	4.63

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 本期国债期货投资政策**

在法律法规允许的范围内，本基金根据风险管理原则，以套期保值为目的，投资于国债期货合约，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，并充分考虑国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等因素，通过多头或空头套期保值等策略进行操作。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)	合约市 值(元)	公允价值变 动(元)	风险指标说明
T2303	10年期国债2303	-3	-3,007,200.00	-1,841.82	-
公允价值变动总额合计(元)					-1,841.82
国债期货投资本期收益(元)					-29,773.31
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-1,841.82

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期内按照相关法律法规的规定，以审慎的态度进行国债期货投资，在一定程度上对冲了利率风险、流动性风险对基金的影响，降低了基金净值的波动。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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) 截至本报告期末，22农业银行CD035（证券代码112203035）为本基金持有的前十大证券。2022年3月21日，发行主体中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业

银行”)因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在十七项违法违规行为,收到中国银保监会罚款480万元的行政处罚(银保监罚决字〔2022〕12号)。2022年9月30日,农业银行因作为托管机构存在未及时发现理财产品投资集中度超标情况,理财托管业务违反资产独立性原则要求,操作管理不到位,收到中国银保监会罚款150万元的行政处罚(银保监罚决字〔2022〕52号)。

本基金认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响,对该公司投资价值未产生实质影响。

(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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	90,216.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	90,216.00

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	839,433.42	0.38

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合A	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合C
基金合同生效日(2022年10月25日)基金份额总额	141,182,103.68	80,375,808.26
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	141,182,103.68	80,375,808.26

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合A	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合C
基金合同生效日管理人持有的本基金份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	9,003,455.00	1,000,495.00
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,003,455.00	1,000,495.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	6.38	1.24

注: 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则买入/申购总份额中包含该业务;

2、如果本报告期间发生转换出业务,则卖出/赎回总份额中包含该业务;

3、分级基金“报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)”的计算中,对下

属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。非分级基金“报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）”的计算中，比例的分母采用期末基金份额总额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、转换、红利再投等。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

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

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

8.3 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

2023年01月20日