

博道和祥多元稳健债券型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年04月11日起至2023年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
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	60
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	61
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
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	62
§9 开放式基金份额变动	63
§10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
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	65
§11 备查文件目录	65
11.1 备查文件目录	65
11.2 存放地点	66
11.3 查阅方式	66

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道和祥多元稳健债券型证券投资基金	
基金简称	博道和祥多元稳健债券	
基金主代码	017134	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年04月11日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	634,060,960.65份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道和祥多元稳健债券A	博道和祥多元稳健债券C
下属分级基金的交易代码	017134	017135
报告期末下属分级基金的份额总额	311,270,393.37份	322,790,567.28份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	在正常市场环境中，本基金将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，力争通过资产配置降低组合波动性，提高基金资产风险调整后收益。此外，本基金通过细分经济场景构建防御因子，多维度监测市场，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×90%+沪深300指数收益率×8%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	博道基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛
	联系电话	021-80226288
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn
客户服务电话	400-085-2888	95566
传真	021-80226289	010-66594942
注册地址	上海市虹口区东大名路1158号301室	北京市西城区复兴门内大街1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	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200122	100818
法定代表人	莫泰山	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露	《中国证券报》
------------	---------

露报纸名称	
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.bdfund.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博道基金管理有限公司	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年04月11日(基金合同生效日)-2023年06月30日)	
	博道和祥多元稳健 债券A	博道和祥多元稳健 债券C
本期已实现收益	633,971.54	373,916.67
本期利润	1,626,050.87	1,401,900.10
加权平均基金份额本期利润	0.0052	0.0043
本期加权平均净值利润率	0.52%	0.43%
本期基金份额净值增长率	0.52%	0.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	633,971.54	373,916.67
期末可供分配基金份额利润	0.0020	0.0012
期末基金资产净值	312,896,444.24	324,192,467.38
期末基金份额净值	1.0052	1.0043

3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
	基金份额累计净值增长率	0.52%

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2023年04月11日，基金合同生效日至本报告期期末，本基金运作时间未满半年。

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

博道和祥多元稳健债券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	0.42%	0.08%	0.36%	0.09%	0.06%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	0.52%	0.05%	0.27%	0.08%	0.25%	-0.03%

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。

博道和祥多元稳健债券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	0.38%	0.08%	0.36%	0.09%	0.02%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	0.43%	0.05%	0.27%	0.08%	0.16%	-0.03%

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

博道和祥多元稳健债券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04月11日-2023年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2023年4月11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。

博道和祥多元稳健债券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04月11日-2023年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2023年4月11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25只公募基金：博道启航混合型证券投资基金、博道卓远混合型证券投资基金、博道中证500指数增强型证券投资基金、博道沪深300指数增强型证券投资基金、博道远航混合型证券投资基金、博道叁佰智航股票型证券投资基金、博道志远混合型证券投资基金、博道伍佰智航股票型证券投资基金、博道嘉泰回报混合型证券投资基金、博道久航混合型证券投资基金、博道嘉瑞混合型证券投资基金、博道安远6个月定期开放混合型证券投资基金、博道嘉元混合型证券投资基金、博道嘉兴一年持有期混合型证券投资基金、博道睿见一年持有期混合型证券投资基金、博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金、博道嘉丰混合型证券投资基金、博道消费智航股票型证券投资基金、博道盛彦混合型证券投资基金、博道成长智航股票型证券投资基金、博道盛兴一年持有期混合型证券投资基金、博道研究恒选混合型证券投资基金、博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金、博道惠泰优选混合型证券投资基金和博道和祥多元稳健债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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、博道和祥多元稳健债券的基金经理、固定收益投资总监	2023-04-11	-	16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

				<p>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、自2023年4月11日起担任博道和祥多元稳健债券型证券投资基金基金经理至今。</p>
--	--	--	--	---

注：

1、对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离职日期"为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，"任职日期"和"离职日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，本公司管理的所有投资组合参与交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况共发生8次，经检查未发现异常；本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023年上半年，中国经济先扬后抑，美国于6月暂停加息但预期仍存，人民币兑美元贬值至7.26附近。总体看，股票方面，沪深300下跌0.75%，中证500上涨2.29%，国证2000上涨7.08%，基金重仓指数下跌3.26%；债券方面，十年期美债利率下行7BP，中国十年期国债下行22BP。

第二季度的经济回落早于我们的预期，PMI从3月的51.9下滑至5月份的48.8，而后微幅反弹至6月的49，地产链条在3月小阳春之后亦重现弱势，百强城市房价上涨个数从一季度末的41个回落至29个，历史上通常对应着货币政策相对宽松的区域；物价方面，5月份CPI为0.2%，PPI为-4.6%，同时，工业企业产成品库存名义同比下降至3.2%，表明工业企业仍处于去库存阶段，但可能正在接近尾声；货币数据方面，社融增速在经历了一季度的扩张之后回落，M1增速亦处低位，在经济活动再次趋冷的情况下，货币活化速度也较低，流动性仍较多地淤居于银行体系，银行开始降低存款利率，央行也于6月出现OMO、MLF、LPR的全面降息。总体而言，从宏观上看，二季度经济再次趋冷，而后政策重启发力，多数股票指数回落，在结构活跃的同时，中特估与AI等热点板块也高位回调，债券市场则单边上涨，利率趋势下行。本基金于本年度4月11日成立，在此背景下，我们秉承稳健建仓的思路，同时均衡配置于股票与债券，减少了股票市场下跌对组合的影响，同时相对积极配置债券市场，实现了净值增长。

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，再次趋冷的经济引起市场对一些中期问题的讨论，但在政策调整似已再次展开的情况下，我们认为，在市场悲观区域，应当避免将长期问题短期化的倾向，事实上，回顾今年以来的经济与市场走势，宏观领先于微观，政策领先于宏观，内部模型显示，在压制股票风险偏好的因素中，向下波动的经济与信贷脉冲并非唯二甚至不是主要的因素，美债利率的重新反弹可能贡献更多影响。展望三季度，在国内政策再次发力的情况下，上述因素可能出现阶段性逆转。而在债券方面，我们维持此前判断，在中性利率未出现趋势上行的情况下，利率下行的概率总体上大于上行的概率，流动性并非制约今年市场的核心因素，经济增长及其不确定性或许才是，因此，始终保持股票与债券的平衡配置可能更有利于抵抗市场的波动。

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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在博道和祥多元稳健债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：博道和祥多元稳健债券型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	17,676,290.76
结算备付金		378,600.44
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	499,650,218.02
其中：股票投资		59,677,056.26
基金投资		-

债券投资		439,973,161.76
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	119,984,945.21
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		637,690,054.43
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30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		723.78
应付赎回款		-
应付管理人报酬		365,527.89
应付托管费		52,218.25
应付销售服务费		106,297.15
应付投资顾问费		-

应交税费		3,633.50
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	72,742.24
负债合计		601,142.81
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	634,060,960.65
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	3,027,950.97
净资产合计		637,088,911.62
负债和净资产总计		637,690,054.43

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：博道和祥多元稳健债券型证券投资基金

本报告期：2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年04月11日（基金合同 生效日）至2023年06月30 日
一、营业总收入		4,477,885.55
1.利息收入		1,341,912.45
其中：存款利息收入	6.4.7.9	409,500.18
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		932,412.27
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,115,910.34
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,156,801.21
基金投资收益		-

债券投资收益	6.4.7.11	1,991,445.29
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	281,266.26
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	2,020,062.76
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	-
减：二、营业总支出		1,449,934.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	973,449.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	139,064.20
3. 销售服务费		283,121.50
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		960.28
8. 其他费用	6.4.7.17	53,339.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,027,950.97
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,027,950.97
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		3,027,950.97

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博道和祥多元稳健债券型证券投资基金

本报告期：2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	634,060,960.65	-	-	634,060,960.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	3,027,950.97	3,027,950.97
（一）、综合收益总额	-	-	3,027,950.97	3,027,950.97
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产	-	-	-	-

生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	634,060,960.65	-	3,027,950.97	637,088,911.62

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

博道和祥多元稳健债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]2535号《关于准予博道和祥多元稳健债券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《博道和祥多元稳健债券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633,815,406.73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0221号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博道和祥多元稳健债券型证券投资基金基金合同》于2023年4月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额634,060,960.65份基金份额,其中认购资金利息折合245,553.92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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《博道和祥多元稳健债券型证券投资基金基金合同》和《博道和祥多元稳健债券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《博道和祥多元稳健债券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、股票（含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于股票、可交换债券和可转换债券（含分离交易可转债）资产的比例合计不高于基金资产的20%，投资于港股通标的股票的资产占股票资产的0%-50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率×90%+沪深300指数收益率×8%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×2%。

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》、《博道和祥多元稳健债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2023年06月30日的财务状况以及

2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2023年4月11日(基金合同生效日)至2023年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,确认为应计利息,包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息,以发生违约的风险为权重,计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额,确认预期信用损失。

于每个资产负债表日,本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的,处于第一阶段,本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的,处于第二阶段,本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后已经发生信用减值的,处于第三阶段,本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具,本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加,认定为处于第一阶段的金融工具,按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附

件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资

管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	13,520,203.57

等于：本金	13,519,359.66
加：应计利息	843.91
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	4,156,087.19
等于：本金	4,154,920.92
加：应计利息	1,166.27
减：坏账准备	-
合计	17,676,290.76

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	59,409,026.73	-	59,677,056.26	268,029.53	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	201,819,677.10	2,172,048.77	204,997,648.77	1,005,922.90
	银行间市场	232,277,889.67	1,951,512.99	234,975,512.99	746,110.33
	合计	434,097,566.77	4,123,561.76	439,973,161.76	1,752,033.23
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	

合计	493,506,593.50	4,123,561.76	499,650,218.02	2,020,062.76
----	----------------	--------------	----------------	--------------

注：如果本报告期末本基金持有中国存托凭证，则股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	119,984,945.21	-
银行间市场	-	-
合计	119,984,945.21	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	2,525.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	2,525.00
应付利息	-

预提费用-审计费	18,340.02
预提费用-信息披露费	27,509.22
预提费用-账户维护费	4,600.00
其他应付	19,768.00
合计	72,742.24

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 博道和祥多元稳健债券A

金额单位：人民币元

项目 (博道和祥多元稳健债券A)	本期 2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	311,270,393.37	311,270,393.37
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	311,270,393.37	311,270,393.37

6.4.7.7.2 博道和祥多元稳健债券C

金额单位：人民币元

项目 (博道和祥多元稳健债券C)	本期 2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	322,790,567.28	322,790,567.28
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	322,790,567.28	322,790,567.28

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、本基金自2023年3月13日至2023年4月7日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人

人民币633,815,406.73元，折合为633,815,406.73份基金份额（其中A类基金份额311,162,338.82份，C类基金份额322,653,067.91份）。根据《博道和祥多元稳健债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币245,553.92元，折合为245,553.92份基金份额（其中A类基金份额108,054.55份，C类基金份额137,499.37份），划入基金份额持有人账户；

4、根据《博道和祥多元稳健债券型证券投资基金基金合同》、《博道和祥多元稳健债券型证券投资基金招募说明书》及《博道基金管理有限公司关于博道和祥多元稳健债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于2023年4月11日(基金合同生效日)至2023年7月10日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务、转换业务和定期定额投资业务自2023年7月11日起开始办理。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 博道和祥多元稳健债券A

单位：人民币元

项目 (博道和祥多元稳健债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	633,971.54	992,079.33	1,626,050.87
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	633,971.54	992,079.33	1,626,050.87

6.4.7.8.2 博道和祥多元稳健债券C

单位：人民币元

项目 (博道和祥多元稳健债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-

本期利润	373,916.67	1,027,983.43	1,401,900.10
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	373,916.67	1,027,983.43	1,401,900.10

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
活期存款利息收入	9,439.11
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	22,481.63
结算备付金利息收入	377,579.44
其他	-
合计	409,500.18

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
卖出股票成交总额	90,030,179.26
减：卖出股票成本总额	90,952,704.71
减：交易费用	234,275.76
买卖股票差价收入	-1,156,801.21

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年 06月30日
债券投资收益——利息收入	1,994,173.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,728.58
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	1,991,445.29

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	2,728.58
买卖债券差价收入	-2,728.58

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	281,266.26
基金投资产生的股利收益	-
合计	281,266.26

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
1.交易性金融资产	2,020,062.76
——股票投资	268,029.53
——债券投资	1,752,033.23
——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	2,020,062.76

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日

	日
审计费用	18,340.02
信息披露费	27,509.22
汇划手续费	2,090.00
账户维护费_中债登	3,000.00
开户费	800.00
账户维护费-上清所	1,600.00
合计	53,339.24

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。

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
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

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 2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	973,449.36
其中：支付销售机构的客户维护费	449,969.00

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.70%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×0.70%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	139,064.20

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道和祥多元稳健债券A	博道和祥多元稳健债券C	合计
博道基金管理有限公司	-	882.38	882.38
中国银行	-	59,338.09	59,338.09
合计	-	60,220.47	60,220.47

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，逐日累计至每月月底，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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

博道和祥多元稳健债券A

份额单位：份

项目	本期 2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
基金合同生效日（2023年04月11日）持有的基金份额	1,999,690.08
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	1,999,690.08
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.64%

博道和祥多元稳健债券C

份额单位：份

项目	本期
	2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日
基金合同生效日（2023年04月11日）持有的基金份额	1,000,045.00
报告期初持有的基金份额	-
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	1,000,045.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.31%

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

于本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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	
	2023年04月11日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	13,520,203.57	9,439.11

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

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国银行，其他存款存放于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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年06月30日
A-1	-
A-1以下	-
未评级	34,377,278.91
合计	34,377,278.91

注：未评级债券为国债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年06月30日
AAA	241,047,363.59
AAA以下	-
未评级	164,548,519.26

合计	405,595,882.85
----	----------------

注：未评级债券为国债、政策性金融债、公司债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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于锁定期届满后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自基金合同生效日满6个月起对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2023年6月30日，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2023年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为637,674,378.45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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	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

2023 年 06 月 30 日							
资产							
银行存款	17,676,290.76	-	-	-	-	-	17,676,290.76
结算备付金	378,600.44	-	-	-	-	-	378,600.44
交易性金融资产	-	-	34,377,278.91	119,253,273.97	286,342,608.88	59,677,056.26	499,650,218.02
买入返售金融资产	119,984,945.21	-	-	-	-	-	119,984,945.21
资产总计	138,039,836.41	-	34,377,278.91	119,253,273.97	286,342,608.88	59,677,056.26	637,690,054.43
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	723.78	723.78
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	365,527.89	365,527.89
应付托管费	-	-	-	-	-	52,218.25	52,218.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-	106,297.15	106,297.15
应交税费	-	-	-	-	-	3,633.50	3,633.50
其他负债	-	-	-	-	-	72,742.24	72,742.24
负债总计	-	-	-	-	-	601,142.81	601,142.81
利率敏感度缺口	138,039,836.41	-	34,377,278.91	119,253,273.97	286,342,608.88	59,075,913.45	637,088,911.62

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2023年06月30日
	1.市场利率下降25个基点	6,488,059.85

2.市场利率上升25个基点	-6,347,149.33
---------------	---------------

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。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于股票、可交换债券和可转换债券（含分离交易可转债）资产的比例合计不高于基金资产的20%，投资于港股通标的股票的资产占股票资产的0%-50%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	59,677,056.26	9.37

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	59,677,056.26	9.37

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2023年6月30日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例为9.37%，因此除市场利率和外汇净资产资产净值无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日
第一层次	59,677,056.26
第二层次	439,973,161.76
第三层次	-
合计	499,650,218.02

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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	59,677,056.26	9.36
	其中：股票	59,677,056.26	9.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	439,973,161.76	68.99
	其中：债券	439,973,161.76	68.99
	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	119,984,945.21	18.82
	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	18,054,891.20	2.83
8	其他各项资产	-	-
9	合计	637,690,054.43	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	612,012.00	0.10
B	采矿业	1,849,814.00	0.29
C	制造业	43,930,445.66	6.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	474,519.00	0.07
E	建筑业	372,446.00	0.06
F	批发和零售业	1,235,027.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	366,664.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,454,136.60	1.01
J	金融业	195,048.00	0.03
K	房地产业	89,122.00	0.01
L	租赁和商务服务业	604,176.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	129,759.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	678,075.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,686.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	2,676,126.00	0.42
S	综合	-	-
	合计	59,677,056.26	9.37

7.2.2 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。

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	603279	景津装备	22,500	705,600.00	0.11
2	300856	科思股份	7,700	606,529.00	0.10
3	688711	宏微科技	10,380	605,569.20	0.10
4	000913	钱江摩托	32,700	596,121.00	0.09
5	002782	可立克	38,300	585,607.00	0.09
6	688639	华恒生物	6,398	578,891.04	0.09
7	002233	塔牌集团	74,300	573,596.00	0.09
8	300855	图南股份	15,800	558,056.00	0.09
9	300206	理邦仪器	37,000	557,960.00	0.09
10	688508	芯朋微	9,600	556,704.00	0.09
11	603605	珀莱雅	4,940	555,256.00	0.09
12	002768	国恩股份	22,900	553,951.00	0.09
13	603979	金诚信	17,800	553,580.00	0.09
14	002004	华邦健康	110,700	553,500.00	0.09
15	002991	甘源食品	7,200	552,240.00	0.09
16	002056	横店东磁	30,300	551,763.00	0.09
17	300775	三角防务	16,300	550,614.00	0.09
18	603466	风语筑	39,600	550,440.00	0.09
19	688389	普门科技	23,400	549,666.00	0.09
20	300575	中旗股份	52,950	549,621.00	0.09
21	002025	航天电器	8,600	548,680.00	0.09
22	601686	友发集团	80,200	548,568.00	0.09
23	002990	盛视科技	14,900	548,320.00	0.09

24	688002	睿创微纳	12,200	546,560.00	0.09
25	603688	石英股份	4,800	546,432.00	0.09
26	300443	金雷股份	15,400	545,930.00	0.09
27	002449	国星光电	61,300	544,957.00	0.09
28	002458	益生股份	44,100	544,635.00	0.09
29	600694	大商股份	30,700	544,311.00	0.09
30	300872	天阳科技	35,000	543,900.00	0.09
31	600054	黄山旅游	42,400	542,720.00	0.09
32	605009	豪悦护理	11,300	542,400.00	0.09
33	600050	中国联通	112,100	538,080.00	0.08
34	601728	中国电信	95,500	537,665.00	0.08
35	003006	百亚股份	31,100	537,408.00	0.08
36	300232	洲明科技	57,000	520,980.00	0.08
37	603032	德新科技	14,300	493,922.00	0.08
38	002179	中航光电	10,700	485,245.00	0.08
39	002985	北摩高科	10,900	480,908.00	0.08
40	002027	分众传媒	70,600	480,786.00	0.08
41	300487	蓝晓科技	7,700	480,634.00	0.08
42	000528	柳工	60,500	477,950.00	0.08
43	603983	丸美股份	14,700	475,545.00	0.07
44	300127	银河磁体	26,200	475,006.00	0.07
45	600497	驰宏锌锗	93,600	469,872.00	0.07
46	000725	京东方 A	114,200	467,078.00	0.07
47	300470	中密控股	10,100	466,822.00	0.07
48	600941	中国移动	5,000	466,500.00	0.07
49	002920	德赛西威	2,800	436,268.00	0.07
50	301039	中集车辆	32,600	431,298.00	0.07
51	300395	菲利华	8,700	428,040.00	0.07
52	002389	航天彩虹	18,876	419,235.96	0.07
53	603808	歌力思	31,500	413,595.00	0.06
54	002603	以岭药业	16,000	411,040.00	0.06

55	300413	芒果超媒	12,000	410,520.00	0.06
56	601567	三星医疗	32,500	410,475.00	0.06
57	603508	思维列控	24,000	409,200.00	0.06
58	600373	中文传媒	30,500	406,260.00	0.06
59	601928	凤凰传媒	34,100	388,740.00	0.06
60	601098	中南传媒	33,000	382,800.00	0.06
61	002446	盛路通信	39,900	377,055.00	0.06
62	300219	鸿利智汇	49,900	366,765.00	0.06
63	301031	中熔电气	2,600	352,846.00	0.06
64	300777	中简科技	7,400	349,724.00	0.05
65	002335	科华数据	9,700	348,715.00	0.05
66	002518	科士达	8,700	348,087.00	0.05
67	603439	贵州三力	20,400	348,024.00	0.05
68	002737	葵花药业	14,200	345,628.00	0.05
69	002215	诺普信	45,800	343,958.00	0.05
70	300791	仙乐健康	11,800	342,672.00	0.05
71	002035	华帝股份	48,200	342,220.00	0.05
72	002980	华盛昌	10,200	341,292.00	0.05
73	300332	天壕环境	29,700	340,659.00	0.05
74	601717	郑煤机	27,200	338,640.00	0.05
75	688777	中控技术	5,380	337,756.40	0.05
76	600696	岩石股份	13,500	336,015.00	0.05
77	688100	威胜信息	11,200	333,872.00	0.05
78	688019	安集科技	2,000	329,660.00	0.05
79	000738	航发控制	13,200	322,080.00	0.05
80	002611	东方精工	53,300	305,942.00	0.05
81	600760	中航沈飞	6,520	293,400.00	0.05
82	000807	云铝股份	22,700	288,971.00	0.05
83	600196	复星医药	9,300	287,370.00	0.05
84	300693	盛弘股份	7,753	286,240.76	0.04
85	002017	东信和平	21,130	277,014.30	0.04

86	300900	广联航空	9,600	276,576.00	0.04
87	300119	瑞普生物	15,400	274,120.00	0.04
88	002648	卫星化学	18,300	273,768.00	0.04
89	002746	仙坛股份	34,700	273,436.00	0.04
90	600502	安徽建工	51,700	272,976.00	0.04
91	002129	TCL中环	8,200	272,240.00	0.04
92	002739	万达电影	21,500	269,610.00	0.04
93	603103	横店影视	15,900	267,756.00	0.04
94	601689	拓普集团	3,300	266,310.00	0.04
95	600588	用友网络	12,600	258,300.00	0.04
96	600546	山煤国际	17,400	251,778.00	0.04
97	688599	天合光能	5,600	238,616.00	0.04
98	688063	派能科技	1,200	237,900.00	0.04
99	002468	申通快递	21,600	233,712.00	0.04
100	001696	宗申动力	32,800	232,224.00	0.04
101	688188	柏楚电子	1,200	226,272.00	0.04
102	002434	万里扬	24,900	222,855.00	0.03
103	000338	潍柴动力	17,800	221,788.00	0.03
104	300316	晶盛机电	3,000	212,700.00	0.03
105	600862	中航高科	8,400	212,604.00	0.03
106	688676	金盘科技	7,000	212,030.00	0.03
107	688268	华特气体	2,600	209,898.00	0.03
108	002353	杰瑞股份	8,300	208,579.00	0.03
109	600531	豫光金铅	32,900	207,270.00	0.03
110	002912	中新赛克	4,700	206,847.00	0.03
111	300194	福安药业	53,300	206,804.00	0.03
112	000555	神州信息	16,800	206,640.00	0.03
113	000902	新洋丰	20,100	206,628.00	0.03
114	600583	海油工程	35,300	206,505.00	0.03
115	600985	淮北矿业	17,900	206,208.00	0.03
116	688208	道通科技	6,800	206,108.00	0.03

117	600060	海信视像	8,300	205,425.00	0.03
118	600959	江苏有线	60,500	204,490.00	0.03
119	600211	西藏药业	3,400	201,960.00	0.03
120	300842	帝科股份	2,100	192,024.00	0.03
121	688390	固德威	1,080	180,208.80	0.03
122	000869	张裕 A	5,400	165,564.00	0.03
123	000936	华西股份	11,800	164,020.00	0.03
124	600835	上海机电	9,500	163,210.00	0.03
125	603118	共进股份	12,200	162,138.00	0.03
126	002194	武汉凡谷	14,700	160,671.00	0.03
127	603000	人民网	5,500	160,600.00	0.03
128	600741	华域汽车	8,600	158,756.00	0.02
129	002594	比亚迪	600	154,962.00	0.02
130	600372	中航电子	10,200	154,836.00	0.02
131	603368	柳药集团	6,000	148,260.00	0.02
132	300910	瑞丰新材	2,900	145,870.00	0.02
133	002609	捷顺科技	12,300	143,418.00	0.02
134	000060	中金岭南	29,300	139,175.00	0.02
135	603916	苏博特	10,500	139,020.00	0.02
136	002367	康力电梯	15,200	138,776.00	0.02
137	300224	正海磁材	10,700	137,602.00	0.02
138	300349	金卡智能	9,900	137,412.00	0.02
139	601311	骆驼股份	14,800	137,344.00	0.02
140	300020	银江技术	14,800	136,900.00	0.02
141	301050	雷电微力	2,100	136,353.00	0.02
142	600480	凌云股份	17,200	135,192.00	0.02
143	300861	美畅股份	3,100	134,447.00	0.02
144	600114	东睦股份	17,600	134,112.00	0.02
145	002158	汉钟精机	5,300	132,288.00	0.02
146	603636	南威软件	8,700	127,629.00	0.02
147	002488	金固股份	18,300	126,270.00	0.02

148	000878	云南铜业	11,400	125,970.00	0.02
149	002429	兆驰股份	22,800	125,400.00	0.02
150	002724	海洋王	14,100	122,388.00	0.02
151	600660	福耀玻璃	3,400	121,890.00	0.02
152	002984	森麒麟	3,800	119,548.00	0.02
153	002649	博彦科技	8,200	115,866.00	0.02
154	002747	埃斯顿	4,100	114,800.00	0.02
155	300428	立中集团	4,900	112,994.00	0.02
156	002698	博实股份	6,400	111,936.00	0.02
157	000034	神州数码	4,200	111,678.00	0.02
158	002605	姚记科技	2,400	111,432.00	0.02
159	603939	益丰药房	3,000	111,000.00	0.02
160	002459	晶澳科技	2,600	108,420.00	0.02
161	300496	中科创达	1,100	105,985.00	0.02
162	688161	威高骨科	2,400	103,944.00	0.02
163	002230	科大讯飞	1,500	101,940.00	0.02
164	600482	中国动力	4,300	100,792.00	0.02
165	002384	东山精密	3,700	95,830.00	0.02
166	688111	金山办公	200	94,444.00	0.01
167	601519	大智慧	13,000	93,080.00	0.01
168	300257	开山股份	6,100	92,537.00	0.01
169	002139	拓邦股份	7,000	91,350.00	0.01
170	603690	至纯科技	2,600	90,584.00	0.01
171	603383	顶点软件	1,600	88,672.00	0.01
172	300308	中际旭创	600	88,470.00	0.01
173	688366	昊海生科	1,000	84,220.00	0.01
174	301087	可孚医疗	1,700	83,810.00	0.01
175	601225	陕西煤业	4,600	83,674.00	0.01
176	601857	中国石油	11,100	82,917.00	0.01
177	600438	通威股份	2,400	82,344.00	0.01
178	000690	宝新能源	11,500	80,730.00	0.01

179	603915	国茂股份	3,800	80,484.00	0.01
180	002841	视源股份	1,200	80,208.00	0.01
181	601608	中信重工	18,800	79,148.00	0.01
182	600223	福瑞达	7,700	79,002.00	0.01
183	600416	湘电股份	4,100	78,269.00	0.01
184	300604	长川科技	1,600	75,984.00	0.01
185	688617	惠泰医疗	200	74,750.00	0.01
186	603806	福斯特	2,000	74,380.00	0.01
187	002151	北斗星通	2,100	73,836.00	0.01
188	000951	中国重汽	4,300	72,455.00	0.01
189	002352	顺丰控股	1,600	72,144.00	0.01
190	002815	崇达技术	5,700	70,965.00	0.01
191	002833	弘亚数控	3,600	70,776.00	0.01
192	600105	永鼎股份	9,500	70,775.00	0.01
193	688789	宏华数科	800	70,664.00	0.01
194	603489	八方股份	1,000	70,120.00	0.01
195	002261	拓维信息	3,600	69,516.00	0.01
196	002929	润建股份	1,600	69,456.00	0.01
197	000811	冰轮环境	4,400	69,344.00	0.01
198	601958	金钼股份	6,200	69,130.00	0.01
199	600508	上海能源	4,700	68,996.00	0.01
200	600103	青山纸业	21,800	68,888.00	0.01
201	601003	柳钢股份	17,000	68,680.00	0.01
202	600557	康缘药业	2,500	68,650.00	0.01
203	600971	恒源煤电	8,800	68,552.00	0.01
204	300857	协创数据	2,600	68,328.00	0.01
205	688425	铁建重工	14,200	68,302.00	0.01
206	000823	超声电子	7,200	68,256.00	0.01
207	300627	华测导航	2,100	68,187.00	0.01
208	603300	华铁应急	12,500	68,125.00	0.01
209	002206	海利得	12,700	68,072.00	0.01

210	000851	高鸿股份	12,500	68,000.00	0.01
211	300388	节能国祯	10,100	67,771.00	0.01
212	002600	领益智造	9,800	67,718.00	0.01
213	002616	长青集团	13,200	67,584.00	0.01
214	300723	一品红	2,300	67,390.00	0.01
215	002234	民和股份	3,700	67,377.00	0.01
216	002977	天箭科技	2,100	67,326.00	0.01
217	002832	比音勒芬	1,900	67,279.00	0.01
218	300034	钢研高纳	1,700	66,963.00	0.01
219	300523	辰安科技	2,800	66,808.00	0.01
220	603567	珍宝岛	4,400	65,824.00	0.01
221	603129	春风动力	400	64,760.00	0.01
222	688169	石头科技	200	64,136.00	0.01
223	300377	赢时胜	7,600	61,560.00	0.01
224	300866	安克创新	700	61,250.00	0.01
225	688066	航天宏图	1,000	60,900.00	0.01
226	002938	鹏鼎控股	2,400	58,296.00	0.01
227	601058	赛轮轮胎	4,900	55,811.00	0.01
228	601888	中国中免	500	55,265.00	0.01
229	600590	泰豪科技	7,700	54,901.00	0.01
230	000661	长春高新	400	54,520.00	0.01
231	600886	国投电力	4,200	53,130.00	0.01
232	300347	泰格医药	800	51,632.00	0.01
233	300751	迈为股份	300	50,814.00	0.01
234	002120	韵达股份	5,300	50,668.00	0.01
235	601669	中国电建	8,800	50,512.00	0.01
236	600702	舍得酒业	400	49,580.00	0.01
237	000596	古井贡酒	200	49,476.00	0.01
238	603444	吉比特	100	49,111.00	0.01
239	603197	保隆科技	900	48,825.00	0.01
240	002410	广联达	1,480	48,085.20	0.01

241	600837	海通证券	5,000	46,100.00	0.01
242	300558	贝达药业	900	43,227.00	0.01
243	600129	太极集团	700	41,643.00	0.01
244	300628	亿联网络	1,180	41,382.60	0.01
245	688041	海光信息	600	40,962.00	0.01
246	688981	中芯国际	800	40,416.00	0.01
247	600988	赤峰黄金	3,000	40,380.00	0.01
248	300059	东方财富	2,700	38,340.00	0.01
248	000733	振华科技	400	38,340.00	0.01
250	600809	山西汾酒	200	37,014.00	0.01
251	600378	昊华科技	900	33,876.00	0.01
252	688187	时代电气	800	33,488.00	0.01
253	300769	德方纳米	300	33,069.00	0.01
254	688005	容百科技	600	32,412.00	0.01
255	603986	兆易创新	300	31,875.00	0.01
256	300101	振芯科技	1,600	31,024.00	0.00
257	002430	杭氧股份	900	30,924.00	0.00
258	002180	纳思达	900	30,825.00	0.00
259	300529	健帆生物	1,300	30,134.00	0.00
260	002415	海康威视	900	29,799.00	0.00
261	688036	传音控股	200	29,400.00	0.00
262	600745	闻泰科技	600	29,340.00	0.00
263	688521	芯原股份	400	28,768.00	0.00
264	600132	重庆啤酒	300	27,648.00	0.00
265	300012	华测检测	1,400	27,300.00	0.00
266	601390	中国中铁	3,600	27,288.00	0.00
267	601100	恒立液压	400	25,732.00	0.00
268	300014	亿纬锂能	400	24,200.00	0.00
269	688180	君实生物	600	23,124.00	0.00
270	300454	深信服	200	22,650.00	0.00
271	002409	雅克科技	300	21,864.00	0.00

272	601186	中国铁建	2,200	21,670.00	0.00
273	002050	三花智控	700	21,182.00	0.00
274	601965	中国汽研	1,000	20,650.00	0.00
275	688385	复旦微电	400	20,040.00	0.00
276	600150	中国船舶	600	19,746.00	0.00
277	603259	药明康德	300	18,693.00	0.00
278	002223	鱼跃医疗	500	17,995.00	0.00
279	300033	同花顺	100	17,528.00	0.00
280	603816	顾家家居	400	15,260.00	0.00
281	002475	立讯精密	400	12,980.00	0.00
282	601799	星宇股份	100	12,360.00	0.00
283	300832	新产业	200	11,800.00	0.00
284	300759	康龙化成	300	11,484.00	0.00
285	300724	捷佳伟创	100	11,235.00	0.00
286	603305	旭升集团	400	11,148.00	0.00
286	002268	电科网安	400	11,148.00	0.00
288	688561	奇安信	200	10,362.00	0.00
289	002928	华夏航空	1,200	10,140.00	0.00
290	000069	华侨城 A	2,300	10,120.00	0.00
291	601633	长城汽车	400	10,068.00	0.00
292	600763	通策医疗	100	9,686.00	0.00
293	002487	大金重工	300	9,252.00	0.00
294	601012	隆基绿能	300	8,601.00	0.00
295	301035	润丰股份	100	7,857.00	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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	603279	景津装备	1,006,997.80	0.16

2	688639	华恒生物	894,265.49	0.14
3	603605	珀莱雅	766,203.80	0.12
4	300487	蓝晓科技	763,517.00	0.12
5	688100	威胜信息	754,681.03	0.12
6	603466	风语筑	752,696.00	0.12
7	688390	固德威	746,012.00	0.12
8	000913	钱江摩托	742,837.00	0.12
9	688599	天合光能	742,205.22	0.12
10	300127	银河磁体	741,266.52	0.12
11	301031	中熔电气	729,900.00	0.11
12	603979	金诚信	723,914.00	0.11
13	003006	百亚股份	721,970.00	0.11
14	300855	图南股份	712,695.00	0.11
15	002458	益生股份	701,096.00	0.11
16	300856	科思股份	677,370.00	0.11
17	002991	甘源食品	676,457.00	0.11
18	600054	黄山旅游	676,421.00	0.11
19	603688	石英股份	663,131.00	0.10
20	600694	大商股份	659,251.00	0.10

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	688390	固德威	579,329.91	0.09
2	601869	长飞光纤	527,258.00	0.08
3	688599	天合光能	515,709.47	0.08
4	002484	江海股份	498,197.00	0.08
5	601137	博威合金	486,773.00	0.08

6	603327	福蓉科技	485,118.30	0.08
7	300842	帝科股份	484,317.00	0.08
8	603383	顶点软件	484,067.00	0.08
9	603027	千禾味业	473,416.00	0.07
10	600584	长电科技	469,859.00	0.07
11	603297	永新光学	461,060.00	0.07
12	002410	广联达	456,111.60	0.07
13	002130	沃尔核材	455,901.00	0.07
14	002048	宁波华翔	452,430.00	0.07
15	600845	宝信软件	444,819.00	0.07
16	300224	正海磁材	439,800.00	0.07
17	300627	华测导航	428,835.00	0.07
18	603368	柳药集团	425,812.00	0.07
19	688100	威胜信息	425,227.25	0.07
20	000739	普洛药业	423,472.00	0.07

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	150,361,731.44
卖出股票收入（成交）总额	90,030,179.26

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	85,744,374.80	13.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	234,975,512.99	36.88
	其中：政策性金融债	92,326,868.85	14.49

4	企业债券	119,253,273.97	18.72
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	439,973,161.76	69.06

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	230205	23国开05	900,000	92,326,868.85	14.49
2	019697	23国债04	500,000	51,367,095.89	8.06
3	019694	23国债01	340,000	34,377,278.91	5.40
4	122737	12石油04	200,000	21,796,739.73	3.42
5	188770	21南网03	200,000	20,854,554.52	3.27

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或者在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(1) 截至本报告期末，23农行二级资本债01A（证券代码232380004）为本基金持有的前十大证券。2022年9月30日，发行主体中国农业银行股份有限公司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。

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

无。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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	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	持有份额	占总份 额比例

	数 (户)			比例		
博道和祥多元稳健债券A	4,318	72,086.71	3,760,175.51	1.21%	307,510,217.86	98.79%
博道和祥多元稳健债券C	5,535	58,318.08	15,913,579.18	4.93%	306,876,988.10	95.07%
合计	9,782	64,819.15	19,673,754.69	3.10%	614,387,205.96	96.90%

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	博道和祥多元稳健债券A	1,073,550.45	0.34%
	博道和祥多元稳健债券C	930.72	0.00%
	合计	1,074,481.17	0.17%

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	博道和祥多元稳健债券A	0
	博道和祥多元稳健债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基	博道和祥多元稳健	0

金	债券A	
	博道和祥多元稳健 债券C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道和祥多元稳健债券 A	博道和祥多元稳健债券 C
基金合同生效日(2023年04月11日)基金份额总额	311,270,393.37	322,790,567.28
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	-	-
本报告期期末基金份额总额	311,270,393.37	322,790,567.28

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券	2	240,391,910.70	100.00%	125,510.47	100.00%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信建投证券	201,819,677.10	100.00%	10,172,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：

1、报告期内，上述交易单元均为本基金新增交易单元；

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博道和祥多元稳健债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-12
2	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加北京雪球基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-04
3	博道基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-06

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道和祥多元稳健债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道和祥多元稳健债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道和祥多元稳健债券型证券投资基金招募说明书》；

- 4、《博道和祥多元稳健债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道和祥多元稳健债券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、报告期内博道和祥多元稳健债券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
二〇二三年八月三十一日