

# 博道和祥多元稳健债券型证券投资基金

## 2025年第1季度报告

2025年03月31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

报告送出日期:2025年04月22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 .....                          | 8  |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 .....                | 9  |
| §5 投资组合报告 .....                                | 9  |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况 .....                         | 9  |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                     | 9  |
| 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 .....     | 10 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                   | 11 |
| 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 .....     | 11 |
| 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 ..... | 11 |
| 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 .....    | 11 |
| 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 .....     | 12 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....                 | 12 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....                | 12 |
| 5.11 投资组合报告附注 .....                            | 12 |
| §6 开放式基金份额变动 .....                             | 13 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 .....                    | 14 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 .....                     | 14 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 .....                 | 14 |
| §8 备查文件目录 .....                                | 14 |
| 8.1 备查文件目录 .....                               | 14 |
| 8.2 存放地点 .....                                 | 15 |
| 8.3 查阅方式 .....                                 | 15 |

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年4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2025年01月01日起至2025年03月31日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 报告期末基金份额总额 | 60,287,495.44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       | 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。                                                                      |                |
| 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                                                                                                                                                                   |                |
| 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 | 41,153,497.90份                                                                                                                                                               | 19,133,997.54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(2025年01月01日 - 2025年03月31日) |               |
|----------------|--------------------------------|---------------|
|                | 博道和祥多元稳健债券A                    | 博道和祥多元稳健债券C   |
| 1.本期已实现收益      | 634,951.00                     | 348,748.04    |
| 2.本期利润         | 264,259.53                     | 122,332.59    |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0062                         | 0.0049        |
| 4.期末基金资产净值     | 44,097,543.68                  | 20,341,237.66 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0715                         | 1.0631        |

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

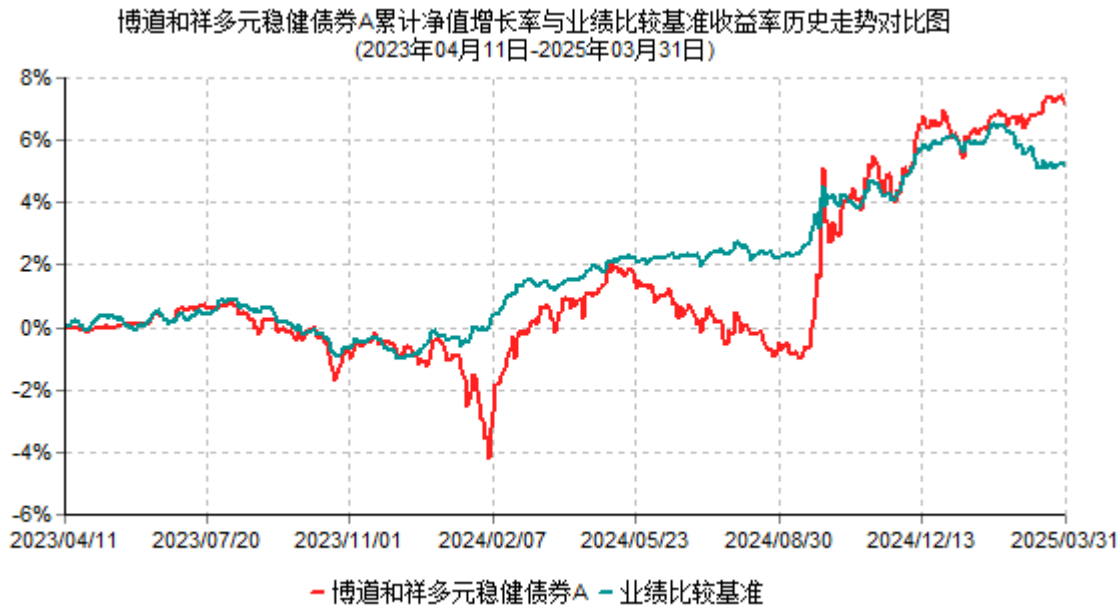
博道和祥多元稳健债券A净值表现

| 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   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月      | 0.54%  | 0.16%     | -0.87%     | 0.12%         | 1.41% | 0.04% |
| 过去六个月      | 3.48%  | 0.31%     | 1.00%      | 0.15%         | 2.48% | 0.16% |
| 过去一年       | 6.63%  | 0.30%     | 3.75%      | 0.14%         | 2.88% | 0.16% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.15%  | 0.26%     | 5.18%      | 0.12%         | 1.97% | 0.14% |

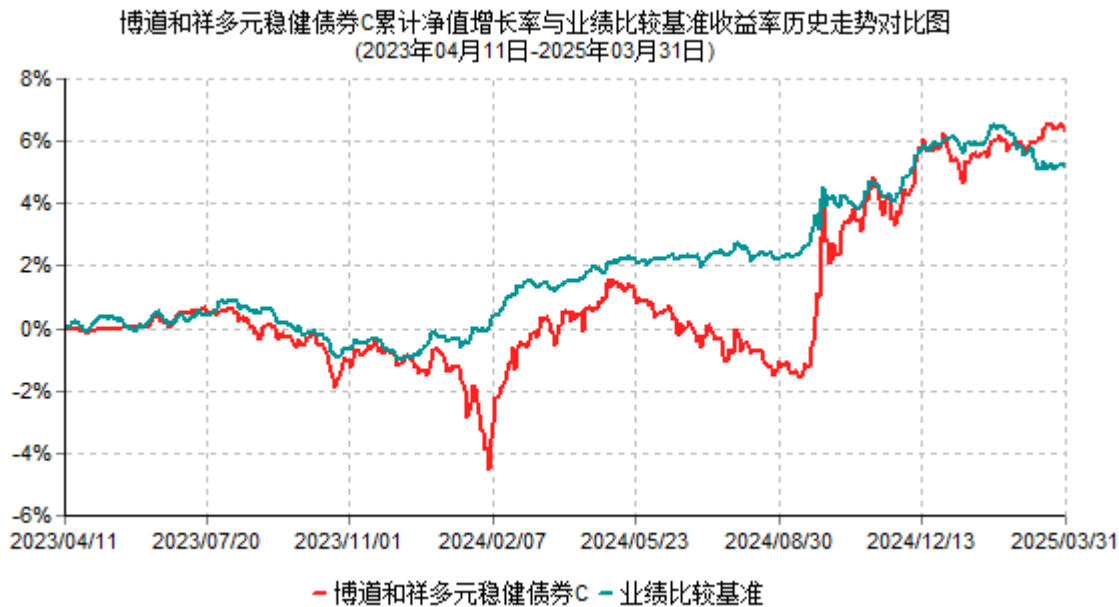
博道和祥多元稳健债券C净值表现

| 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   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月      | 0.45%  | 0.17%     | -0.87%     | 0.12%         | 1.32% | 0.05% |
| 过去六个月      | 3.27%  | 0.31%     | 1.00%      | 0.15%         | 2.27% | 0.16% |
| 过去一年       | 6.20%  | 0.30%     | 3.75%      | 0.14%         | 2.45% | 0.16% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.31%  | 0.26%     | 5.18%      | 0.12%         | 1.13% | 0.14% |

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



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。



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          | 离任 |        |    |

|     |                                                                           | 日期         | 日期 |     |                                                                                                                                                                                                                |
|-----|---------------------------------------------------------------------------|------------|----|-----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 陈连权 | 博道盛利6个月持有期混合、博道和祥多元稳健债券、博道中证同业存单AAA指数7天持有期、博道和裕多元稳健30天持有期债券的基金经理、固定收益投资总监 | 2023-04-11 | -  | 18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。具有基金从业资格。 |

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1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

一季度，股票市场总体表现分化，债券市场出现调整，利率下行后触底回升，国内经济仍处于回暖区间。全季看，沪深300下跌1.21%，中证500上涨2.31%，中证1000上涨4.51%；债券方面，十年期国债利率下行至1.60%之后触底反弹，收于1.81%，利率体系总体仍处于低位，但利差体系开始扩散。

一季度，经济总体延续回暖，PMI从12月份的50.1下降至1月的49.1，而后再次回升至3月份的50.5，1-2月份发电量累计同比下降1.3%，铁路货运量累计同比上升0.25%，均较2024年四季度有所下滑，与前期相比，经济的复苏势头可能有一定的放缓；价格方面，CPI下行至2月份的-0.7%，部分受春节错位因素影响，PPI在2月份录得-2.2%；政策方面，一季度MLF利率维持在2%，7天OMO逆回购利率维持在1.5%，央行改变了MLF的招标方式，MLF政策利率的色彩逐步淡化，同时，央行在一季度暂停了国债买卖，货币市场维持了紧平衡的状态。

海外方面，在美国经济出现下滑之后，市场开始预期美国经济的滞胀风险，而美联储尚处于观望，美股与美元指数出现下行。

往后看，我们维持此前对市场可能会经历一个“政策急转向，经济缓修复，资产再平衡”脉冲过程的判断，如果风险偏好延续回暖，经济体内部的流动性传导机制得以畅通，预计经济基本面与市场也将随之缓慢回升。

本基金在一季度在基金合同约定的资产配置比例范围内总体维持较高的权益比例。风格与选股方面，遵循多因子模型，在成长与价值当中总体保持均衡，市值风格适中，债券配置方面，动态调节了组合久期。

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              | 12,674,467.33 | 15.93        |
|    | 其中：股票             | 12,674,467.33 | 15.93        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 62,209,261.13 | 78.19        |
|    | 其中：债券             | 62,209,261.13 | 78.19        |
|    | 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      | 4,505,995.03  | 5.66         |
| 8  | 其他资产              | 175,118.61    | 0.22         |
| 9  | 合计                | 79,564,842.10 | 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 | 122,758.00   | 0.19         |
| B  | 采矿业      | 205,446.00   | 0.32         |
| C  | 制造业      | 7,819,813.33 | 12.14        |

|   |                     |               |       |
|---|---------------------|---------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业    | 524,072.00    | 0.81  |
| E | 建筑业                 | 125,877.00    | 0.20  |
| F | 批发和零售业              | 371,171.00    | 0.58  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业         | 888,039.00    | 1.38  |
| H | 住宿和餐饮业              | -             | -     |
| I | 信息传输、软件和信息<br>技术服务业 | 500,206.00    | 0.78  |
| J | 金融业                 | 1,524,714.00  | 2.37  |
| K | 房地产业                | 158,757.00    | 0.25  |
| L | 租赁和商务服务业            | 69,745.00     | 0.11  |
| M | 科学研究和技术服务业          | 192,223.00    | 0.30  |
| N | 水利、环境和公共设施<br>管理业   | 150,142.00    | 0.23  |
| O | 居民服务、修理和其他<br>服务业   | -             | -     |
| P | 教育                  | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作             | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业           | 16,338.00     | 0.03  |
| S | 综合                  | 5,166.00      | 0.01  |
|   | 合计                  | 12,674,467.33 | 19.67 |

### 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   | 156,100.00 | 0.24         |
| 2  | 688696 | 极米科技  | 800   | 106,768.00 | 0.17         |
| 3  | 002028 | 思源电气  | 1,300 | 98,800.00  | 0.15         |
| 4  | 002001 | 新 和 成 | 4,300 | 96,234.00  | 0.15         |
| 5  | 601966 | 玲珑轮胎  | 5,400 | 95,796.00  | 0.15         |

|    |        |       |        |           |      |
|----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 6  | 000895 | 双汇发展  | 3,500  | 94,395.00 | 0.15 |
| 7  | 300770 | 新媒股份  | 2,300  | 91,149.00 | 0.14 |
| 8  | 601222 | 林洋能源  | 13,700 | 90,146.00 | 0.14 |
| 9  | 000725 | 京东方 A | 21,500 | 89,225.00 | 0.14 |
| 10 | 601398 | 工商银行  | 12,900 | 88,881.00 | 0.14 |

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      | 50,076,619.05 | 77.71        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | 12,132,642.08 | 18.83        |
| 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        | 62,209,261.13 | 96.54        |

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  | 019755 | 24国债19 | 160,000 | 16,058,454.80 | 24.92        |
| 2  | 019751 | 24国债16 | 100,000 | 10,107,638.36 | 15.69        |
| 3  | 019761 | 24国债24 | 98,000  | 9,759,892.49  | 15.15        |
| 4  | 138743 | 22信投G7 | 60,000  | 6,113,413.81  | 9.49         |
| 5  | 242132 | 24国君S2 | 60,000  | 6,019,228.27  | 9.34         |

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

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

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<br>(买/卖) | 合约市值<br>(元)   | 公允价值<br>变动 (元) | 风险指标说明    |
|--------------------|------------|--------------|---------------|----------------|-----------|
| TL2506             | 30年期国债2506 | -4           | -4,641,600.00 | 4,800.00       | -         |
| 公允价值变动总额合计 (元)     |            |              |               |                | 4,800.00  |
| 国债期货投资本期收益 (元)     |            |              |               |                | 58,986.17 |
| 国债期货投资本期公允价值变动 (元) |            |              |               |                | 4,800.00  |

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) 2024年4月30日，广东证监局公示〔2024〕35号行政监管措施决定书，对中信建投证券股份有限公司采取出具警示函的行政监管措施。

2024年4月30日，中国证监会北京监管局公示〔2024〕99号行政监管措施决定书，对中信建投证券股份有限公司采取责令增加合规检查次数的行政监管措施。

2024年5月17日，江苏证监局公示〔2024〕91号行政监管措施决定书，对中信建投证券股份有限公司采取出具警示函的行政监管措施。

2024年10月18日，中国证监会公示行政监管措施决定书，对中信建投证券股份有限公司采取监管谈话的行政监管措施。

2025年1月10日，中国证监会北京监管局公示行政监管措施决定书，对中信建投证券股份有限公司采取责令改正的行政监管措施。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

（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   | 162,456.00 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 12,662.61  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 175,118.61 |

**5.11.4 报告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。

**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

|  |            |            |
|--|------------|------------|
|  | 博道和祥多元稳健债券 | 博道和祥多元稳健债券 |
|--|------------|------------|

|                               | A             | C             |
|-------------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 42,886,899.07 | 28,092,247.37 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 6,793,936.83  | 4,910,546.06  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 8,527,338.00  | 13,868,795.89 |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>（份额减少以“-”填列） | -             | -             |
| 报告期期末基金份额总额                   | 41,153,497.90 | 19,133,997.54 |

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

|                          | 博道和祥多元稳健债券A  | 博道和祥多元稳健债券C  |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 1,999,690.08 | 1,000,045.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -            | -            |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -            | -            |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 1,999,690.08 | 1,000,045.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 4.86         | 5.23         |

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。

## 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](http://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

2025年04月22日