

# 博道嘉瑞混合型证券投资基金

2023年第4季度报告

2023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:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2024年01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遵规守信情况的说明	8
4.3 公平交易专项说明	8
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	10
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	11
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	12
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	13
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	13
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	15
§8 影响投资者决策的其他重要信息	15
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	15
§9 备查文件目录	16
9.1 备查文件目录	16
9.2 存放地点	16
9.3 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年1月19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2023年10月01日起至2023年12月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	博道嘉瑞混合
基金主代码	008467
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年12月30日
报告期末基金份额总额	556,486,203.80份
投资目标	在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置和投资管理，追求超越基金业绩比较基准的资本增值。
投资策略	充分发挥基金管理人的研究优势，在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，确定并动态调整大类资产的投资比例。通过宏观、中观和微观不同层面影响行业景气度和行业市场表现因素的综合分析，挑选出预期具有较好市场表现的行业，优选基本面因素良好、估值水平合理的上市公司构建股票组合。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，本基金将优选基本面因素良好、估值水平合理的港股纳入本基金的股票投资组合。本基金债券投资策略主要包括久期管理策略、期限结构配置策略、类属配置策略、个券选择等积极的投资策略。本基金的可转换债券和可

	交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%+中债综合全价(总值)指数收益率×40%	
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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博道嘉瑞混合A	博道嘉瑞混合C
下属分级基金的交易代码	008467	008468
报告期末下属分级基金的份额总额	452,350,511.74份	104,135,692.06份

注：自2021年10月28日起，本基金业绩比较基准由"沪深300指数收益率×60%+中债综合全价(总值)指数收益率×40%"调整为"沪深300指数收益率×55%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%+中债综合全价(总值)指数收益率×40%"。

### §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(2023年10月01日 - 2023年12月31日)	
	博道嘉瑞混合A	博道嘉瑞混合C
1.本期已实现收益	-49,175,836.86	-12,065,494.34
2.本期利润	-22,400,971.22	-5,111,553.27
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0478	-0.0455
4.期末基金资产净值	599,138,690.84	135,174,938.35
5.期末基金份额净值	1.3245	1.2981

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

博道嘉瑞混合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
过去三个月	-3.00%	0.91%	-3.88%	0.47%	0.88%	0.44%
过去六个月	-10.53%	0.87%	-6.19%	0.50%	-4.34%	0.37%
过去一年	-13.52%	0.88%	-6.07%	0.50%	-7.45%	0.38%
过去三年	-21.77%	1.25%	-19.62%	0.66%	-2.15%	0.59%
自基金合同生效起至今	32.45%	1.30%	-5.51%	0.71%	37.96%	0.59%

博道嘉瑞混合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
过去三个月	-3.13%	0.91%	-3.88%	0.47%	0.75%	0.44%
过去六个月	-10.75%	0.87%	-6.19%	0.50%	-4.56%	0.37%
过去一年	-13.96%	0.88%	-6.07%	0.50%	-7.89%	0.38%
过去三年	-22.94%	1.25%	-19.62%	0.66%	-3.32%	0.59%
自基金合同生效起至今	29.81%	1.30%	-5.51%	0.71%	35.32%	0.59%

#### 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

博道嘉瑞混合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  
(2019年12月30日-2023年12月31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。

博道嘉瑞混合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  
(2019年12月30日-2023年12月31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		
张迎军	博道嘉泰回报混合、博道嘉瑞混合、博道嘉元混合、博道嘉兴一年持有期混合、博道嘉丰混合的基金经理、研究总监兼基金投资部总经理	2019-12-30	-	23年	张迎军先生，中国籍，经济学硕士。2000年7月至2003年3月担任申银万国证券研究所市场研究部、策略研究部研究员，2003年4月至2006年11月担任中国太平洋保险（集团）股份有限公司资金运用管理中心投资经理，2006年12月至2008年5月担任太平洋资产管理有限公司组合管理部组合经理，2008年8月至2015年7月担任交银施罗德基金管理有限公司基金经理、固定收益部副总经理、权益部副总经理、投资副总监，2015年9月至2018年11月担任上海放山资产管理有限公司总经理。2019年5月加入博道基金管理有限公司，现任研究总监兼基金投资部总经理。具有基金从业资格。自2019年12月19日起担任博道嘉泰回报混合型证券投资基金基金经理至今、自2019年12月30日起担任博道嘉瑞混合型证券投资基金基金经理至今、自2020年3月4日起担任博道嘉元混合型证券投资基金基金经理至今、自2020年10月23日起担任博道嘉兴一年持有期混合型证券投资基金基金

					经理至今、自2021年2月1日起担任博道嘉丰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

2023年四季度，市场情绪在海外流动性改善的背景下仍然较为低迷，股市延续弱势。沪深300下跌7.00%，中证500下跌4.60%，中证1000下跌3.15%，上证指数下跌4.36%，



创业板指下跌5.62%，恒生指数下跌4.28%。从行业来看，煤炭、电子、农林牧渔表现较好，分别上涨了4.47%、3.95%、1.76%，房地产、建材、消费者服务表现较差，分别下跌13.83%、13.30%、11.12%。2023年四季度本基金主要增持了汽车整车及零配件、能源、通讯设备等相关股票，对以煤炭为代表的低估值高分红类股票进行了止盈式波段操作，减持了包括互联网传媒、计算机应用、医疗器械等高估值板块的配置比例。

经济基本面方面，四季度经济表现弱势平稳，通胀和库存周期磨底，虽然价格和去库存的压力较上半年有所缓解，但价格和库存仍然低迷，PPI在6月探底到同比下降5.4%后，逐步改善至9月的-2.5%，之后有所反复，又回落到11月的-3%左右。产成品库存在8月、9月小幅补库之后又进入去库，整体库存在低位徘徊。政策方面，一揽子化债、地产需求释放、三大工程、增发国债等政策陆续出台，但市场对地产长周期变化引发的“债务-通缩螺旋”等问题仍然担忧。年末，债市在再融资债和增发国债的冲击后，再次聚焦内需不足的矛盾，又迎来了一段利率下行。海外方面，美联储12月议息会议基本宣告加息周期结束，鲍威尔称本次会议讨论了降息时点问题，释放明确降息信号，美联储全面下调2023-2025年通胀预测，或为后续降息进一步铺垫；点阵图指示2024年降息3次，全球流动性或出现转折点。

本基金认为，2023年四季度A股市场表现继续低迷的重要原因在于中国经济增长正处于新旧动能转换的重要时期，目前的经济增长速度相比于过去二十年处于较低水平，虽然季度经济增速有一定企稳回升迹象，但企业盈利改善迹象还不明显。过去两年多A股市场的持续下跌，也给投资者信心带来较大冲击。基于资产溢价的情况来看，股市股权风险溢价再度达到2倍标准差的水平，而债券市场的期限利率和信用利差已经被压到极致，从中长期战略配置角度，虽然很难准确预测股票债券资产溢价何时回归，但方向是明确的，目前A股的定价与估值水平存在较大的修正空间与投资机会。

经过2023年市场的洗礼，展望2024年的A股市场，本基金认为可以从以下几个维度去寻找投资机会。

1、周期视角：美联储是否有更为明确的信号开启降息周期，以及中国经济在没有强刺激政策下进一步延续复苏态势，是决定是否会有春季躁动行情以及行情力度的重要变量。

2、深度价值投资机会：在投资者对经济增长前景信心不足，市场处于底部区域时期，往往会出现较好的深度价值投资机会，深度价值的标准如下：第一、PE/PB指标衡量的估值处于很低水平。第二、较高且稳定的分红率。在A股历史上，阶段性较高分红率的公司有一批，但高分红的持续性较差。随着中国经济从高速增长阶段向高质量增长阶段转变，一些行业的供给侧开始出清，龙头公司资本开支逐渐下降，伴随着政策鼓励分红，高比例分红成为常态化，行业的周期属性减弱、价值特征增强，这样，深度价值投资机会就逐渐呈现。无论从赔率还是胜率判断，深度价值都是投资的最佳击球点。

3、关注新的变化，追随创新步伐：当周期处于下行阶段，市场的焦点会更多聚焦在新的变化上。而创新特别是科技创新，则是最耀眼的变化。作为中国科技创新的代表之一，华为无疑值得关注，密切跟踪科技创新产业链可能是追随创新步伐的便捷路径。

此外，2024年新的变化还可能自于两个方面，预期内的，比如对A股市场相关制度完善与经济刺激的政策，预期外的，比如时局变化与市场周期运行误判的纠偏。

4、寻找有品牌有定价权的出海企业：当“产能过剩、内需不足、内循环依然存在堵点”时，出口不仅具有宏观意义，在中观与微观也具有重要意义。相对而言，一些海外发达国家在专利保护、品牌意识、反不正当价格竞争等方面，为企业创造了更好的商业环境。当部分出海的中国企业逐步树立自身品牌具备定价权时，就能获得高于国内市场并且相对稳定的毛利与净利率，这样的成长股投资逻辑会更能被市场接受。

5、“困境反转”类公司：2023年，传媒、计算机等板块表现突出，一方面可能是源于插上了人工智能的翅膀，更深层次的原因，本基金认为是具备了“困境反转”的基本条件。经过2年多的市场下跌，目前多数行业与公司的股价与基本面都处于寻底区域，也就具备了“困境”的一些基本特征。是否出现“反转”的契机，一方面需要关注经济与行业运行周期的变化，特别是二阶拐点的出现，另一方面需要关注外部变量的产生。外部变量可以是政策，也可以是技术创新的外溢效应，或者其他。此外，我们观察到2023年产业主题投资在A股市场重新占据重要位置，预计2024年这一趋势仍将延续。而主题投资与“困境反转”具有诸多共振的元素，因此，2024年A股市场最大的投资机会可能依然还是来自于看似产业主题投资的“困境反转”类机会。

本基金将坚持“以长期视角正确把握公司的合理价值，以合理价格买入优秀公司”的基本原则，尊重市场、顺势而为，面对市场出现的新变化，在控制组合整体风险的前提下，保持开放心态努力参与，勤勉尽责，力争为投资者获得有竞争力的收益水平。

#### 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	574,176,913.63	77.22
	其中：股票	574,176,913.63	77.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	119,162,017.88	16.03
	其中：债券	119,162,017.88	16.03

	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	42,190,835.61	5.67
8	其他资产	8,001,328.88	1.08
9	合计	743,531,096.00	100.00

注：1、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；

2、本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值及占基金资产净值比例请见“5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合”部分披露。

## 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	63,869,641.65	8.70
C	制造业	382,663,345.38	52.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,271,986.00	2.49
F	批发和零售业	12,413,198.81	1.69
G	交通运输、仓储和邮政业	13,538.61	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,309,723.53	8.21
J	金融业	12,797,644.86	1.74
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	26,564.46	0.00
N	水利、环境和公共设施管	19,002.11	0.00

	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	550,387,703.41	74.95

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
主要消费	11,670,554.90	1.59
房地产	12,118,655.32	1.65
合计	23,789,210.22	3.24

注：以上分类采用中证CICS一级分类标准编制。

### 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	300274	阳光电源	599,600	52,518,964.00	7.15
2	300750	宁德时代	284,474	46,443,225.24	6.32
3	600150	中国船舶	1,359,861	40,034,307.84	5.45
4	688012	中微公司	207,661	31,896,729.60	4.34
5	300049	福瑞股份	679,800	29,632,482.00	4.04
6	300751	迈为股份	227,094	29,410,943.94	4.01
7	603019	中科曙光	609,684	24,076,421.16	3.28
8	000603	盛达资源	2,054,073	22,697,506.65	3.09
9	600256	广汇能源	3,086,700	22,039,038.00	3.00
10	600050	中国联通	4,873,100	21,344,178.00	2.91

### 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	39,060,867.72	5.32

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）	80,101,150.16	10.91
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	119,162,017.88	16.23

### 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	110085	通22转债	279,410	30,294,374.74	4.13
2	019678	22国债13	213,000	21,550,231.23	2.93
3	110079	杭银转债	130,300	14,105,946.00	1.92
4	102229	国债2301	127,000	12,946,748.82	1.76
5	127006	敖东转债	75,105	8,203,626.55	1.12

**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**  
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**  
本基金本报告期内未进行国债期货投资。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

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	-
2	应收证券清算款	7,761,166.84
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	240,162.04
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	8,001,328.88

### 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	110085	通22转债	30,294,374.74	4.13
2	110079	杭银转债	14,105,946.00	1.92
3	127006	敖东转债	8,203,626.55	1.12
4	123133	佩蒂转债	8,185,142.75	1.11
5	113066	平煤转债	5,523,004.30	0.75
6	123107	温氏转债	4,694,826.80	0.64
7	128095	恩捷转债	3,569,400.97	0.49
8	118004	博瑞转债	2,828,857.04	0.39
9	113049	长汽转债	2,695,971.01	0.37

### 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

	博道嘉瑞混合A	博道嘉瑞混合C
报告期期初基金份额总额	532,512,859.86	114,284,202.72
报告期期间基金总申购份额	7,504,724.22	10,531,907.87
减：报告期期间基金总赎回份额	87,667,072.34	20,680,418.53
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	452,350,511.74	104,135,692.06

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

	博道嘉瑞混合A	博道嘉瑞混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	1,370,200.18	680,400.00
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	1,370,200.18	680,400.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.30	0.65

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 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20231001-20231231	163,905,824.59	9,861,932.94	-	173,767,757.53	31.23%
产品特有风险							
<p>本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。</p>							

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道嘉瑞混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道嘉瑞混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道嘉瑞混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道嘉瑞混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道嘉瑞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、报告期内博道嘉瑞混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 9.3 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

2024年01月22日