

博道和祥多元稳健债券型证券投资基金

2024年第2季度报告

2024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

报告送出日期:2024年07月19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	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	9
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	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	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	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	12
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	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 备查文件目录	15
8.1 备查文件目录	15
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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年7月17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2024年04月01日起至2024年06月30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	131,949,147.87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	82,131,879.05份	49,817,268.82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(2024年04月01日 - 2024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
1.本期已实现收益	1,212,180.66	674,503.60
2.本期利润	313,172.24	141,559.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.0031	0.0024
4.期末基金资产净值	82,584,497.29	49,846,094.60
5.期末基金份额净值	1.0055	1.0006

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

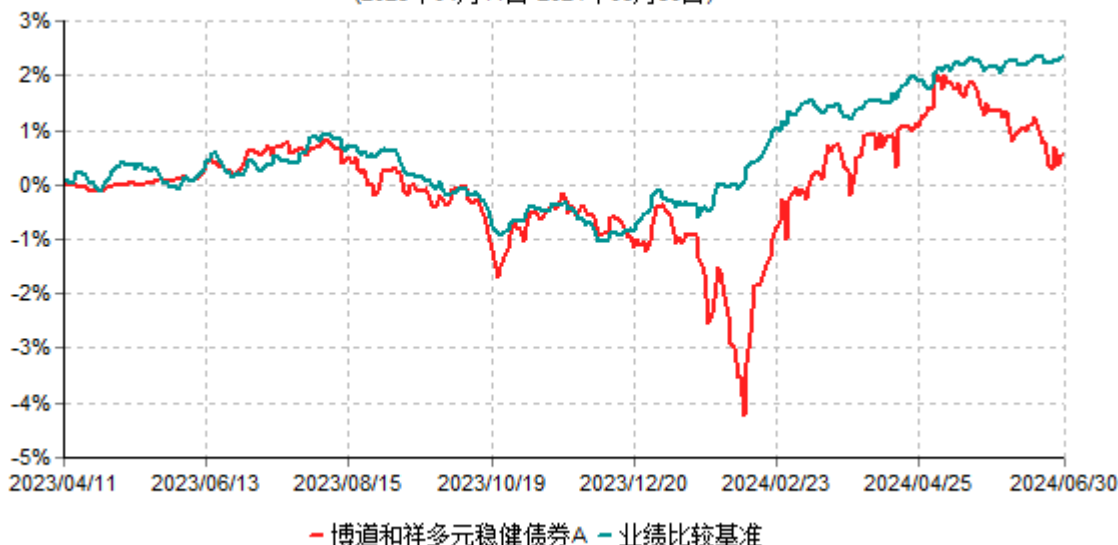
博道和祥多元稳健债券A净值表现

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	0.06%	0.22%	0.95%	0.07%	-0.89%	0.15%
过去六个月	0.94%	0.29%	2.43%	0.09%	-1.49%	0.20%
过去一年	0.03%	0.23%	2.06%	0.09%	-2.03%	0.14%
自基金合同生效起至今	0.55%	0.21%	2.34%	0.09%	-1.79%	0.12%

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	-0.04%	0.22%	0.95%	0.07%	-0.99%	0.15%
过去六个月	0.75%	0.29%	2.43%	0.09%	-1.68%	0.20%
过去一年	-0.37%	0.23%	2.06%	0.09%	-2.43%	0.14%
自基金合同生效起至今	0.06%	0.21%	2.34%	0.09%	-2.28%	0.12%

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-2024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。截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。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-2024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。截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。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	说明

		任职日期	离任日期	年限	
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、博道中证同业存单AAA指数7天持有期的基金经理、固定收益投资总监	2023-04-11	-	17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、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、自2023年10月24日起担任博道中证同业存单AAA指数7天持有期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遵规守信情况的说明

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，本公司管理的所有投资组合未出现参与的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成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024年二季度，市场在反弹之后再归平淡，基本面亦有转弱迹象，美联储降息预期反复，股市总体下跌，沪深300下跌2.14%，中证500下跌6.50%，中证1000下跌10.02%；债券方面，十年期国债利率从2.29%下行至2.20%，利率体系总体在低位运行。

2024年二季度，经济数据有所反复，PMI从3月份50.8下行至6月份的49.5，经济呈现出供给修复、需求回落的特征，结构上分化延续，景气度较高的主要是生产端、出口和电力投资，需求端和价格偏弱，整体仍然是量增价减的环境；政策方面，政治局会议在稳增长方面释放了较为积极的信号，市场对财政和货币政策仍抱有期待，在地产政策连续放松下，部分城市的二手房成交也有所好转。另一方面，在金融增加值核算方式优化调整的背景下，社融、M2、M1等金融数据有所走弱，M2从3月份的8.3%下行至5月份的

7%，而资本市场出于对一些小企业挤出效应的担忧，市场风险偏好再度下降，虽然央行多次提示利率较低，但债券市场仍然因避险情绪而受追捧。

海外方面，美国降息预期依然“折返跑”频繁，最新的CPI数据增加了对通胀可持续下降的信心，美联储需要等待更多的证据确认通胀的趋势。值得注意的是，美联储预期长期政策利率从此前的2.6%进一步上调至2.8%，意味着长债利率中枢或出现抬升。

往后看，实质性地促进国内经济循环回升仍是影响利率与股票市场的根本力量，美联储在下半年能否如预期降息也可能扰动市场，如果经济出现确定性的回升，美联储开启降息，通胀才可能确实回升。

本基金二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，减持了部分信用债，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。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	25,773,845.74	16.42
	其中：股票	25,773,845.74	16.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	125,063,971.07	79.68
	其中：债券	125,063,971.07	79.68
	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	950,000.00	0.61
	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	5,160,743.06	3.29
8	其他资产	300.00	0.00
9	合计	156,948,859.87	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	1,276,590.00	0.96
C	制造业	19,112,660.96	14.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	388,852.00	0.29
E	建筑业	156,984.00	0.12
F	批发和零售业	303,222.80	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	480,681.00	0.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,686,818.98	1.27
J	金融业	1,115,671.00	0.84
K	房地产业	494,050.00	0.37
L	租赁和商务服务业	28,798.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	259,857.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	8,157.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	461,503.00	0.35

S	综合	-	-
	合计	25,773,845.74	19.46

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	600066	宇通客车	12,900	332,820.00	0.25
2	600926	杭州银行	25,500	332,775.00	0.25
3	002463	沪电股份	8,300	302,950.00	0.23
4	603979	金诚信	5,600	282,968.00	0.21
5	688188	柏楚电子	1,400	258,370.00	0.20
6	688036	传音控股	3,353	256,638.62	0.19
7	688208	道通科技	10,400	251,056.00	0.19
8	002249	大洋电机	51,800	245,014.00	0.19
9	600114	东睦股份	16,900	243,191.00	0.18
10	000975	银泰黄金	14,700	239,463.00	0.18

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	21,824,513.70	16.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	31,307,674.90	23.64
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	51,985,581.92	39.25
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,101,043.84	7.63
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	9,845,156.71	7.43
9	其他	-	-
10	合计	125,063,971.07	94.44

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	019727	23国债24	110,000	11,200,094.52	8.46
2	122737	12石油04	100,000	10,871,369.86	8.21
3	019697	23国债04	100,000	10,624,419.18	8.02
4	188770	21南网03	100,000	10,520,277.26	7.94
5	2228017	22邮储银行二级01	100,000	10,481,227.40	7.91

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 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邮储银行二级01（证券代码2228017）为本基金持有的前十大证券。2023年7月7日，发行主体中国邮政储蓄银行股份有限公司因违反反假货币业务管理规定等8项违法行为，收到中国人民银行警告，罚款3186万元的行政处罚（银罚决字〔2023〕39号）。

截至本报告期末，22建设银行二级01（证券代码2228039）为本基金持有的前十大证券。2023年11月22日，发行主体中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）因单个网点在同一会计年度内与超过3家保险公司开展保险业务合作等18项主要违法违规事实，收到国家金融监督管理总局没收违法所得并处罚款合计3791.879382万元的行政

处罚（金罚决字〔2023〕29号），其中，总行2041.879382万元，分支机构1750万元。2024年1月5日，建设银行因并表管理内部审计存在不足等4项主要违法违规事实，收到国家金融监督管理总局罚款170万元的行政处罚（金罚决字〔2023〕41号）。

截至本报告期末，23中证G3（证券代码138911）为本基金持有的前十大证券。2023年7月7日，发行主体中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）因在2023年6月19日的网络安全事件中，存在机房基础设施建设安全性不足，信息系统设备可靠性管理疏漏等问题，被深圳证监局采取出具警示函的行政监管措施（行政监管措施决定书〔2023〕102号），2023年8月29日因相同事项被上海证券交易所予以书面警示（监管措施决定书〔2023〕37号），2023年9月22日因相同事项收到深圳证券交易所警示函（深证函〔2023〕654号）。2023年9月22日，中信证券因在担任航天通信控股集团股份有限公司收购智慧海派科技有限公司重大资产重组财务顾问过程中存在违规情形，被中国证监会采取监管谈话的行政监管措施。2024年1月5日，中信证券因保荐的恒逸石化股份有限公司（发行人）可转债项目，发行人证券发行上市当年即亏损、营业利润比上年下滑50%以上，被中国证监会采取出具警示函的行政监督管理措施。2024年4月30日，中信证券因知悉客户融券目的是定增套利，配合其提供融券服务，共同违反限制性规定转让“中核钛白”股票，收到中国证监会采取责令改正，给予警告，合计没收违法所得1,910,680.83元，并处以23,250,000元罚款的行政处罚（中国证监会行政处罚决定书〔2024〕45号）。2024年4月30日，中信证券因在担任方大智源科技股份有限公司首次公开发行股票并在创业板上市申请项目保荐人过程中存在违规行为，被深圳证监局采取书面警示的自律监管措施（深证函〔2024〕312号）。2024年5月8日，中信证券因作为广东泉为科技股份有限公司首次公开发行股票持续督导机构，在持续督导履职过程中存在违规行为，被广东证监局采取出具警示函的行政监管措施（行政监管措施决定书〔2024〕41号）。

截至本报告期末，21中金G7（证券代码185097）为本基金持有的前十大证券。2024年1月5日，发行主体中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）因作为泰禾集团股份有限公司（以下简称“泰禾集团”）公司债券受托管理人，在受托管理期间未严格遵守执业行为准则，存在未对泰禾集团未披露相关重大债务逾期及诉讼事项保持必要关注、未在年度受托管理事务报告中披露相关重大事项等情形，被证监会采取出具警示函的监督管理措施。2024年1月12日，中金公司因在资产证券化专项计划管理工作中，存在建立基础资产现金流归集机制不到位且管理不善，未能切实防范专项计划现金流被侵占、挪用等问题，被浙江证监局采取出具警示函的监督管理措施，并记入证券期货市场诚信档案。2024年4月24日，中金公司因合规管理存在聘用未取得从业资格的人员开展相关证券业务、对员工行为监测监控不到位等问题，被中国证监会北京监管局采取出具警示函的行政监管措施。2024年4月28日，中金公司因存在自营和投顾账户间发生交易、利益冲突管理不到位、开展场外期权业务不审慎、对子公司业务和投资行为管理不到位、公司治理不规范的情况，反映出公司未能有效实施合规管理，内部控制不完善，被中国证监会北京监管局采取责令增加合规检查次数的行政监管措施（〔2024〕97号）。

2024年5月9日，中金公司因开展资产管理业务时存在因操作风险造成流动性缺口、违规提供通道服务、同日反向交易未列明决策依据、产品账户间互相发生交易等问题，被中国证监会北京监管局采取责令改正的行政监管措施（〔2024〕117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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	300.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	300.00

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 A	博道和祥多元稳健债券 C
报告期期初基金份额总额	124,635,226.63	75,428,850.06
报告期期间基金总申购份额	51,226.86	4,262,946.25

减：报告期期间基金总赎回份额	42,554,574.44	29,874,527.49
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	82,131,879.05	49,817,268.82

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（%）	2.43	2.01

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）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07月19日