

路博迈护航一年持有期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:路博迈基金管理(中国)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30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3月21日（基金合同生效日）起至6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	6
§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	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	11
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	14
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	14
§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	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55

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.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
11.1 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.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金	
基金简称	路博迈护航一年持有债券	
基金主代码	017975	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年03月21日	
基金管理人	路博迈基金管理（中国）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	4,092,732,274.14份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	路博迈护航一年持有 债券A	路博迈护航一年持有 债券C
下属分级基金的交易代码	017975	017976
报告期末下属分级基金的份额总额	2,262,182,047.62份	1,830,550,226.52份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，以获取绝对收益为核心投资目标，通过积极主动的投资管理，力争实现组合资产长期稳健的增值。
投资策略	基金管理人将以“自上而下”角度、以资产配置思路来构建组合。在资产配置层面将重点关注各类资产的未来收益变化情况，根据不同资产的收益做第一层面的配置，关注较为长期的影响资产收益波动的关键力量。本基金具体的投资策略包括债券投资策略、股票及港股通投资策略、基金投资策略、流动性管理策略以及衍生产品投资策略等。
业绩比较基准	中债新综合财富(总值)指数收益率*85%+中证800指数收益率*8%+恒生指数收益率*2%+1年期定期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。

	本基金可投资港股通标的的股票，需承担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		路博迈基金管理（中国）有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林海中	许俊
	联系电话	021-32063717	010-66596688
	电子邮箱	haizhong.lin@nbchina.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4008755888	95566
传真		021-32063700	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道88号30层11单元	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市静安区石门一路288号香港兴业中心二座7楼705-710室	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200041	100818
法定代表人		阎小庆	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.nbchina.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	路博迈基金管理（中国）有限	中国上海市静安区石门一路288号香

公司	港兴业中心二座7楼705-710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03月21日（基金合同生效日）-2023年06月30日)	
	路博迈护航一年持有债券A	路博迈护航一年持有债券C
本期已实现收益	5,237,465.12	2,210,497.93
本期利润	928,921.35	-1,274,175.39
加权平均基金份额本期利润	0.0004	-0.0007
本期加权平均净值利润率	0.04%	-0.07%
本期基金份额净值增长率	0.04%	-0.07%
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	928,901.84	-1,274,192.76
期末可供分配基金份额利润	0.0004	-0.0007
期末基金资产净值	2,263,110,949.46	1,829,276,033.76
期末基金份额净值	1.0004	0.9993
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	0.04%	-0.07%

注：1、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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所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（例如，申购、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

路博迈护航一年持有债券A

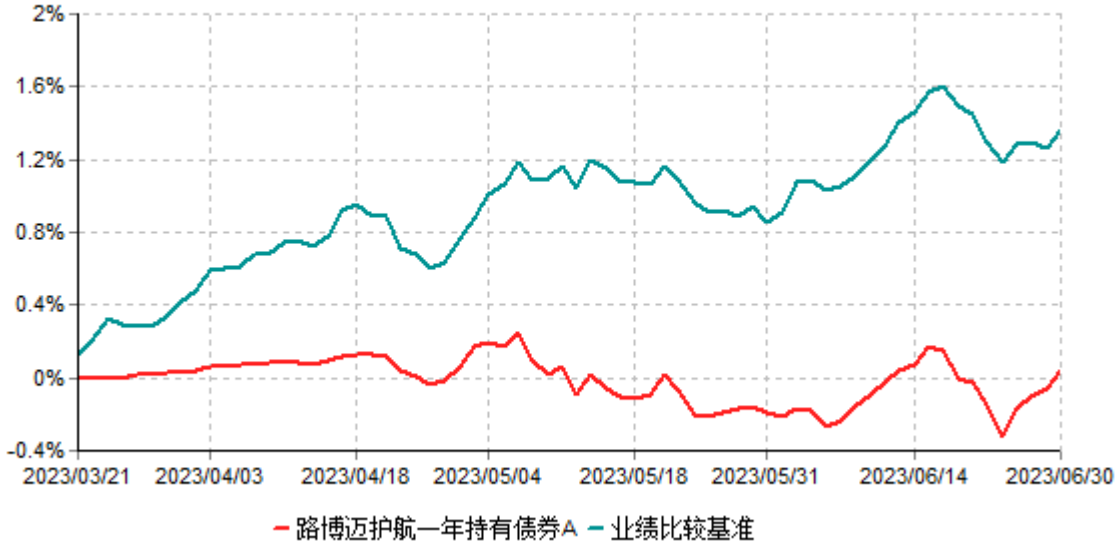
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.23%	0.09%	0.50%	0.09%	-0.27%	0.00%
过去三个月	0.00%	0.07%	0.88%	0.08%	-0.88%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	0.04%	0.07%	1.36%	0.08%	-1.32%	-0.01%

路博迈护航一年持有债券C

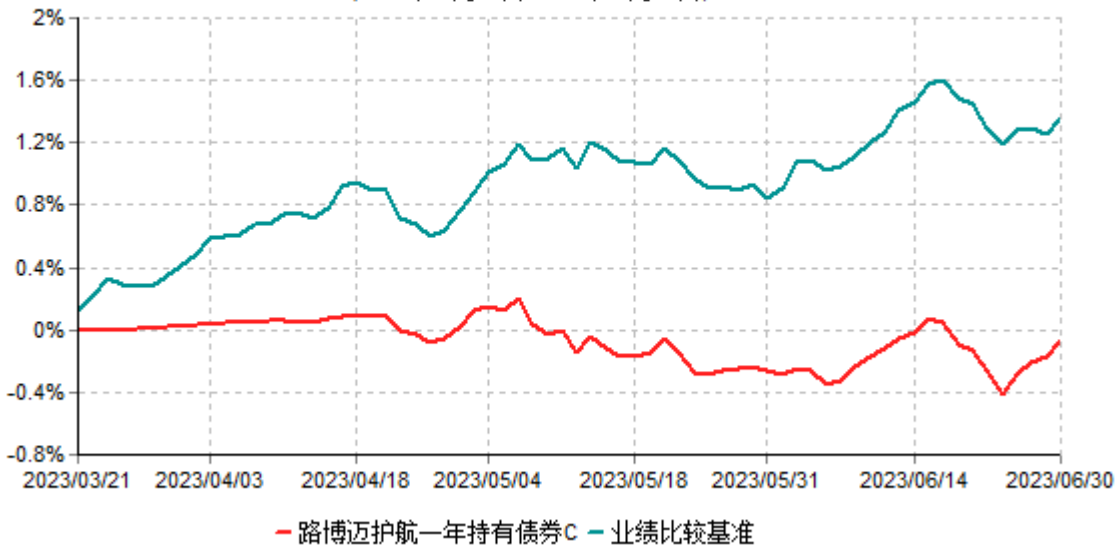
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.19%	0.09%	0.50%	0.09%	-0.31%	0.00%
过去三个月	-0.10%	0.07%	0.88%	0.08%	-0.98%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	-0.07%	0.07%	1.36%	0.08%	-1.43%	-0.01%

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

路博迈护航一年持有债券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03月21日-2023年06月30日)



路博迈护航一年持有债券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03月21日-2023年06月30日)



注：1、本基金合同于2023年3月21日生效，截至本报告期末，本基金合同生效未满一年。
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，截至报告期末本基金仍在建仓期。

§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

路博迈基金管理（中国）有限公司于2021年9月22日经中国证券监督管理委员会《关于核准设立路博迈基金管理（中国）有限公司的批复》（证监许可[2021]3094号）批准设立，由路博迈投资顾问有限公司（Neuberger Berman Investment Advisers LLC）全资持有。截至报告期末，公司共管理2只公开募集证券投资基金：路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金、路博迈中国机遇混合型证券投资基金。

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		
汝平	副总经理、基金经理	2023-03-21	-	12年	汝平，美国国籍，美国德雷塞尔大学物理博士学位，美国卡内基梅隆大学信息网络(金融类)硕士学位，复旦大学物理学学士学位。现任路博迈基金管理（中国）有限公司副总经理、基金经理。曾任职于美国摩根士丹利投资管理公司、摩根士丹利华鑫基金、景顺长城基金、上海富诚海富通资产管理、银河基金。
周平	量化投资部总经理、基金经理	2023-03-21	-	6年	周平，中国国籍，美国乔治亚州立大学会计学博士学位、复旦大学国际金融学硕士研究生，西南财经大学颁授经济(会计)学士学位。现任路博迈基金管理（中国）有限公司量化投资部总经理、基金经理。

					周平博士驻于纽约时，曾隶属于路博迈全球量化及多资产投资部(QMAC)，曾负责量化多资产及量化股票投资。
--	--	--	--	--	---

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

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

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，投资经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在中央交易室集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，确保公平交易制度的执行和实现。本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现投资组合之间存在利益输送等不公平交易行为，公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了公平交易制度和异常交易监控细则，同时加强对组合间同向交易和同日反向交易的监控和检查。公司利用公平交易分析系统，对组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易进行分析。公司禁止组合内的同日反向交易，严格控

制组合间的同日反向交易，对采用量化投资策略的组合与其他组合间发生的同日反向交易进行监控和分析。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合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总成交量5%的交易次数为0次。

本报告期内，各组合投资交易未发现异常情况。

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，在经历一季度线下场景修复和积压需求释放后，内外需求再度转弱，二季度经济复苏动能明显放缓。需求端来看，由于收入承压及预期转弱，居民消费和商品房销售均不及预期。企业部门则受制于盈利收缩和资本开支增长承压，加杠杆意愿不足。

2023年上半年债市在宏观基本面修复整体趋势转弱、资产荒、资金面宽松、央行降息等利好下收益率震荡下行，截至2023年6月30日，10年国债较年初下行20BP至2.64%，10年期国开债下行31BP至2.77%，中债中短期票据到期收益率（AAA）1年期下行24BP至2.47%，3年期下行39BP至2.78%，5年期下行44BP至3.06%。

股市方面，2023年上半年呈现高开低走的态势。受疫情政策优化刺激，投资者预期中国经济在2023年会有V型复苏，外资一月净流入达到历史高点，A股和港股一月表现强劲，中证800指数上涨超过7%，恒生指数更是大涨超过10%。春节后，较高频的经济数据显示中国经济复苏弱于投资者的预期，房地产销售持续低迷，居民消费意愿不足，同时美联储持续加息，全球流动性收紧，人民币兑美元在二季度出现较为显著的贬值趋势，A股和港股持续回调。截止2023年6月30日，中证800指数今年的收益不足1%，而恒生指数完全抹去一月的涨幅，今年下跌超过4%。尽管大盘指数表现欠佳，市场中仍不乏亮点，其中以“中特估”为代表的低估值、高分红国企以及与人工智能相关的算力、算法和数据供应商的表现最为突出。我们认为“中特估”行情的爆发既有特定的事件属性，也是低估值、高分红国企价值回归的表现。在当前固收类证券的收益率持续下行到低位的宏观环境下，低估值、高分红国企的投资价值显得更加突出，对绝对收益投资者的吸引力显著上升。由ChatGPT引爆的全球人工智能投资热潮也使得A股和港股市场中相关股票的价格飙涨。我们认为ChatGPT为代表的交互式人工智能将会给我们的生活带来深远的影响，孕育着丰富的投资机会。不过，由于人工智能技术发展和应用的高度不确定性，叠加股票市场的羊群效应，相关公司股价大幅波动是必然现象，投资者需要紧密关注相关风险。另一方面，前两年市场关注度很高的新能源、医药和大消费领域在今年表现不佳。股价的短期变化由资金和情绪驱动，但长期由基本面驱动。一些新能源、医药和大消费领域的公司的业绩在持续增长，但估值相比高点已经大幅回调，当前已具有相当吸引力。

本基金于2023年3月21日募集成立，债券组合的主要操作是建仓，逐步建立利率债和信用债的仓位。利率从3月初起快速下行对债券组合的建仓相对不利，我们也随之调整了组合策略，加大了对信用债的配置。展望后市，在利率波动震荡市中信用债票息收入策略依然是性价比最高的策略。

权益投资方面我们坚持红利+成长的两轮驱动策略。其中，红利策略注重防守和绝对收益，成长策略则侧重盈利驱动的成长股投资。同时，我们的组合在行业和个股配置上比较均衡分散。我们认为这种策略安排能更好应对快速变化的市场环境，降低波动，获取更平稳的长期收益，符合固收+产品对权益资产配置的需求。展望后市，我们认为在低利率环境下高股息股具有较强的吸引力。即使经济复苏继续低于预期，此类公司也有较高的概率获取绝对收益。另一方面，如果下半年经济复苏或政策超预期，成长股也会有不错的机会，而且这种机会不会仅限于人工智能相关主题。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金A类份额净值1.0004元，本报告期内净值增长率0.04%，同期业绩比较基准收益率1.36%；截至本报告期末，本基金C类份额净值0.9993元，本报告期内净值增长率-0.07%，同期业绩比较基准收益率1.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，居民就业和收入预期仍未企稳，欧美等主要经济体增速继续放缓，三季度经济仍面临很大压力，市场预期逆周期政策可能会加码，国内经济增速有望保持平稳。对债市而言，稳增长政策加码对债市的扰动不可忽视，后续利率可能出现宽幅波动的行情，并随着经济现实与预期的分歧加大波动，我们对债市持有谨慎乐观的态度。我们对股市的态度更乐观一些。当前权益市场的低迷估值已经较为充分地反映了经济基本面较弱的担忧。今年政策力度弱于预期，但后续政策有超预期的可能。汇率方面，人民币兑美元的阶段性贬值受多重因素影响，其中中美利差是影响短期汇率的重要因素。然而，高利率对美国经济有遏制作用，长期高利率将显著恶化美国企业与个人的资产负债表及美国政府的财政状况。因此，市场预期明年一季度美联储将开始降息，通常美元指数在美联储开始降息前开始走低。当前权益市场的风险溢价（股息率-十年期国债收益率）处在历史上比较高的水平，这意味着权益资产相对于固定收益资产的性价比较高。综合来看，我们认为当前权益市场的估值具有吸引力，向下空间有限，组合中权益资产的配置处于中性偏多的位置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，委托基金服务机构对基金所持有的投资品种进行估值，本基金

托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金管理人及委托的基金服务机构严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，基金份额净值经基金托管人复核无误后由基金管理人对外披露。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金基金合同的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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”）在路博迈护航一年持有期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：路博迈护航一年持有期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	1,792,192.27
结算备付金		21,910,630.83
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,052,429,471.55
其中：股票投资		483,422,355.22
基金投资		-
债券投资		3,569,007,116.33
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	19,993,669.26
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		3,015.67
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		4,096,128,979.58
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		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		2,351,654.19
应付托管费		503,925.89
应付销售服务费		600,730.35
应付投资顾问费		-
应交税费		112,677.51
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	173,008.42
负债合计		3,741,996.36
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	4,092,732,274.14
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	-345,290.92
净资产合计		4,092,386,983.22
负债和净资产总计		4,096,128,979.58

注：1、报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 4,092,732,274.14 份，其中 A 类基金份额净值 1.0004 元，基金份额 2,262,182,047.62 份；C 类基金份额净值 0.9993 元，基金份额 1,830,550,226.52 份。

2、本基金基金合同于 2023 年 3 月 21 日生效，无上年度可比期间数据。

6.2 利润表

会计主体：路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 03 月 21 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 03 月 21 日（基金合同
----	-----	-----------------------------

		生效日) 至2023年06月30 日
一、营业总收入		11,360,887.27
1.利息收入		11,409,958.63
其中：存款利息收入	6.4.7.9	983,676.68
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		10,426,281.95
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,744,145.73
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-14,565,863.69
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	16,674,590.74
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-1,606.24
股利收益	6.4.7.13	5,637,024.92
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）	6.4.7.14	-7,793,217.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-
减：二、营业总支出		11,706,141.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,925,159.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,698,248.37
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,024,918.81
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		18,257.76
8. 其他费用	6.4.7.15	39,557.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-345,254.04
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-345,254.04
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-345,254.04

注：本基金基金合同于 2023 年 3 月 21 日生效，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金

本报告期：2023年03月21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03月21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）	4,092,714,670.68	-	-	4,092,714,670.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	17,603.46	-	-345,290.92	-327,687.46

(一)、综合收益总额	-	-	-345,254.04	-345,254.04
(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)	17,603.46	-	-36.88	17,566.58
其中：1.基金申购款	17,603.46	-	-36.88	17,566.58
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)	4,092,732,274.14	-	-345,290.92	4,092,386,983.22

注：本基金基金合同于 2023 年 3 月 21 日生效，无上年度可比期间数据。

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：

阎小庆

阎小庆

黄恩典

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

路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2023 年 2 月 16 日证监许可【2023】323 号《关于准予路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，本基金由基金管理人依照《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规以及《路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金基金合同》的规定公开募集。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。基金管理人和注册登记机构均为路博迈基金管理（中国）有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。有关基金募集文件已按规定向中国证监会备案，基金合同于 2023 年 3 月 21 日正式生效，生效日的基金份额总额为 4,092,714,670.68 份，其中 A 类份额总额 2,262,168,703.14 份，C 类基金份额总额 1,830,545,967.54 份，经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验字第 2300623 号验资报告予以验证。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券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、信用衍生品、国债期货、银行存款、同业存单、现金、经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（不包含 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金和其他投资范围包含基金的基金、货币市场基金）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）。

本基金业绩比较基准：中债新综合财富(总值)指数收益率*85%+中证800指数收益率*8%+恒生指数收益率*2%+1年期定期存款利率(税后)*5%。

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》、《路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、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3月21日（基金合同生效日）至2023年6月30日止期间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6月30日的财务状况以及2023年3月21日（基金合同生效日）至2023年6月30日止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3月21日（基金合同生效日）至2023年6月30日止期间。

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、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。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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、资产支持证券投资和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。

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。本基金收益以现金分红形式与红利再投资形式分配，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。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。

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和债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债金融估值中心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(可转换债券和资产支持证券除外)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》及中国证券投资基金业协会于2022年12月30日发布的《关于固定收益品种的估值处理标准》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(可转换债券和资产支持证券除外),及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/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/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/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	1,216,575.87
等于：本金	1,216,065.96
加：应计利息	509.91
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	575,616.40
等于：本金	575,501.19
加：应计利息	115.21
减：坏账准备	-
合计	1,792,192.27

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	501,200,902.80	-	483,422,355.22	-17,778,547.58	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	824,640,607.35	7,028,455.92	833,270,455.92	1,601,392.65
	银行间市场	2,698,407,062.16	28,945,660.41	2,735,736,660.41	8,383,937.84
	合计	3,523,047,669.51	35,974,116.33	3,569,007,116.33	9,985,330.49
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	4,024,248,572.31	35,974,116.33	4,052,429,471.55	-7,793,217.09	

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	19,993,669.26	-
银行间市场	-	-
合计	19,993,669.26	-

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	22,925.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	22,925.00
应付利息	-
预提费用-审计费	12,482.76
预提费用-信息披露费	17,832.66
其他应付	119,768.00
合计	173,008.42

6.4.7.7 实收基金**6.4.7.7.1 路博迈护航一年持有债券A**

金额单位：人民币元

项目 (路博迈护航一年持有债券A)	本期 2023年03月21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	2,262,168,703.14	2,262,168,703.14
本期申购	13,344.48	13,344.48
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,262,182,047.62	2,262,182,047.62

6.4.7.7.2 路博迈护航一年持有债券C

金额单位：人民币元

项目 (路博迈护航一年持有债券C)	本期 2023年03月21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	1,830,545,967.54	1,830,545,967.54
本期申购	4,258.98	4,258.98
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,830,550,226.52	1,830,550,226.52

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润**6.4.7.8.1 路博迈护航一年持有债券A**

单位：人民币元

项目 (路博迈护航一年持有债券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	5,237,465.12	-4,308,543.77	928,921.35

本期基金份额交易产生的变动数	24.97	-44.48	-19.51
其中：基金申购款	24.97	-44.48	-19.51
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,237,490.09	-4,308,588.25	928,901.84

6.4.7.8.2 路博迈护航一年持有债券C

单位：人民币元

项目 (路博迈护航一年持有债券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	2,210,497.93	-3,484,673.32	-1,274,175.39
本期基金份额交易产生的变动数	3.01	-20.38	-17.37
其中：基金申购款	3.01	-20.38	-17.37
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,210,500.94	-3,484,693.70	-1,274,192.76

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月21日（基金合同生效日）至2023年06月30日
活期存款利息收入	147,639.11
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	22,429.92
结算备付金利息收入	812,237.07
其他	1,370.58
合计	983,676.68

注：其他存款利息收入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利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月21日（基金合同生效日）至2023年06月30日
卖出股票成交总额	398,820,468.88
减：卖出股票成本总额	411,929,933.47
减：交易费用	1,456,399.10
买卖股票差价收入	-14,565,863.69

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03月21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	15,625,249.53
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,049,341.21
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	16,674,590.74

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03月21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	555,085,022.04

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	549,590,503.96
减：应计利息总额	4,356,924.82
减：交易费用	88,252.05
买卖债券差价收入	1,049,341.21

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023年03月21日（基金合同生效日）至2023年06月30日
期货投资	-1,606.24

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年03月21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	5,637,024.92
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,637,024.92

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2023年03月21日（基金合同生效日）至2023年06月30日
1.交易性金融资产	-7,793,217.09
——股票投资	-17,778,547.58
——债券投资	9,985,330.49
——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	-7,793,217.09

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月21日（基金合同生效日）至2023年06月30日
审计费用	12,482.76
信息披露费	17,832.66
汇划手续费	8,841.73
开户费	400.00
合计	39,557.15

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期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
路博迈基金管理（中国）有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期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03月21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	7,925,159.22
其中：支付销售机构的客户维护费	3,794,691.52

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03月21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	1,698,248.37

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 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03月21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		
	路博迈护航一年持有债券A	路博迈护航一年持有债券C	合计
中国银行股份有限公司	0.00	1,992,799.69	1,992,799.69
合计	0.00	1,992,799.69	1,992,799.69

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 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

本基金本报告期末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**

路博迈护航一年持有债券A

份额单位：份

项目	本期 2023年03月21日（基金合同生效日）至2 023年06月30日
基金合同生效日（2023年03月21日）持有的基金份额	8,556,839.51
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	8,556,839.51
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.38%

路博迈护航一年持有债券C

份额单位：份

项目	本期 2023年03月21日（基金合同生效日）至2 023年06月30日
基金合同生效日（2023年03月21日）持有的基金份额	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%

例	
---	--

注：1、申购含红利再投、转换入、级别调整入份额，赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

2、基金管理人投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

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

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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03月21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	1,216,575.87	147,639.11

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

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/增发证券的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股	股	停	停	期	复	复	数量	期末成本	期末估值	备
---	---	---	---	---	---	---	----	------	------	---

票代码	票名称	牌日期	牌原因	末估值单价	牌日期	牌开盘单价	(股)	总额	总额	注
601298	青岛港	2023-06-28	重大资产重组	6.97	2023-07-03	7.40	563,000	4,151,403.00	3,924,110.00	-

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

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了内部管理制度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。

公司建立架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险管理机构由董事会及风险控制委员会、总经理及风险管理委员会、督察长、法律合规部、风险管理部以及各个业务部门组成。公司各部门或岗位之间的监督制约，构成风险控制的第一道监控防线；由公司总经理负责，风险管理委员会、投资决策委员会、督察长、法律合规部和风险管理部构成风险控制的第二道监控防线；在董事会领导下，风险控制委员会负责内部控制和风险管理的决策，构成了风险控制的第三道监控防线。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。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。

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	111,067,150.27
合计	111,067,150.27

注：1、债券评级取自第三方评级机构。

2、债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

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	392,594,223.23
合计	392,594,223.23

注：1、债券评级取自第三方评级机构。

2、债券投资以全价列示。

6.4.13.2.3 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	1,553,375,311.45
AAA以下	-

未评级	1,511,970,431.38
合计	3,065,345,742.83

注：1、债券评级取自第三方评级机构。

2、债券投资以全价列示。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时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。

流动性风险发生时，本基金的基金管理人按流动性风险处置预案处理。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关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组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,792,192.27	-	-	-	1,792,192.27
结算备付金	-	-	-	21,910,630.83	21,910,630.83
交易性金融资产	635,678,543.01	2,724,586,492.25	208,742,081.07	483,422,355.22	4,052,429,471.55
买入返售金融资产	19,993,669.26	-	-	-	19,993,669.26
应收申购款	-	-	-	3,015.67	3,015.67
资产总计	657,464,404.54	2,724,586,492.25	208,742,081.07	505,336,001.72	4,096,128,979.58
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,351,654.19	2,351,654.19
应付托管费	-	-	-	503,925.89	503,925.89
应付销售服务费	-	-	-	600,730.35	600,730.35
应交税费	-	-	-	112,677.51	112,677.51
其他负债	-	-	-	173,008.42	173,008.42
负债总计	-	-	-	3,741,996.36	3,741,996.36
利率敏感度缺口	657,464,404.54	2,724,586,492.25	208,742,081.07	501,594,005.36	4,092,386,983.22

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；	
假设	此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
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
	市场利率上升25个基点	-21,516,674.77
	市场利率下降25个基点	21,756,225.20

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、债券及基金，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。

本基金的投资组合比例为：对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%；权益类资产、可转换债券和可交换债券的投资比例合计不超过基金资产的20%。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，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	483,422,355.22	11.81
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,569,007,116.33	87.21
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	4,052,429,471.55	99.02

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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
	业绩比较基准上升5%	133,507,599.69
	业绩比较基准下降5%	-133,507,599.69

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

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	479,498,245.22
第二层次	3,572,931,226.33
第三层次	-
合计	4,052,429,471.55

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06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

截止资产负债表日，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	483,422,355.22	11.80
	其中：股票	483,422,355.22	11.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,569,007,116.33	87.13
	其中：债券	3,569,007,116.33	87.13

	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	19,993,669.26	0.49
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	23,702,823.10	0.58
8	其他各项资产	3,015.67	0.00
9	合计	4,096,128,979.58	100.00

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	-	-
B	采矿业	16,828,768.00	0.41
C	制造业	223,796,659.71	5.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,575,608.71	0.60
E	建筑业	30,067,786.00	0.73
F	批发和零售业	3,781,995.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	27,513,401.00	0.67
H	住宿和餐饮业	4,443,775.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,922,407.00	0.83
J	金融业	101,878,069.80	2.49
K	房地产业	4,882,341.00	0.12
L	租赁和商务服务业	5,408,020.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	6,323,524.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	483,422,355.22	11.81

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通过港股通机制投资港股。

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	300750	宁德时代	73,140	16,733,700.60	0.41
2	601318	中国平安	282,951	13,128,926.40	0.32
3	601398	工商银行	2,361,900	11,384,358.00	0.28
4	600060	海信视像	442,801	10,959,324.75	0.27
5	600519	贵州茅台	6,100	10,315,100.00	0.25
6	002056	横店东磁	498,600	9,079,506.00	0.22
7	601958	金钼股份	770,600	8,592,190.00	0.21
8	601009	南京银行	1,067,200	8,537,600.00	0.21
9	601319	中国人保	1,162,200	6,787,248.00	0.17
10	002459	晶澳科技	162,560	6,778,752.00	0.17
11	300274	阳光电源	57,800	6,741,214.00	0.16
12	002371	北方华创	19,900	6,321,235.00	0.15
13	601336	新华保险	169,200	6,221,484.00	0.15
14	600066	宇通客车	407,900	6,012,446.00	0.15
15	600600	青岛啤酒	56,900	5,896,547.00	0.14
16	601668	中国建筑	1,005,500	5,771,570.00	0.14
17	600919	江苏银行	781,000	5,740,350.00	0.14
18	600760	中航沈飞	126,420	5,688,900.00	0.14
19	600886	国投电力	446,700	5,650,755.00	0.14

20	002568	百润股份	154,907	5,630,869.45	0.14
21	002600	领益智造	814,200	5,626,122.00	0.14
22	600674	川投能源	366,200	5,511,310.00	0.13
23	600820	隧道股份	914,900	5,498,549.00	0.13
24	300896	爱美客	12,200	5,428,390.00	0.13
25	600415	小商品城	634,000	5,408,020.00	0.13
26	000596	古井贡酒	21,800	5,392,884.00	0.13
27	300316	晶盛机电	75,900	5,381,310.00	0.13
28	603369	今世缘	101,300	5,348,640.00	0.13
29	002422	科伦药业	178,000	5,283,040.00	0.13
30	603345	安井食品	35,500	5,211,400.00	0.13
31	000999	华润三九	85,800	5,204,628.00	0.13
32	601838	成都银行	426,000	5,201,460.00	0.13
33	002304	洋河股份	39,000	5,122,650.00	0.13
34	601577	长沙银行	659,800	5,120,048.00	0.13
35	600570	恒生电子	114,900	5,088,921.00	0.12
36	002131	利欧股份	2,212,400	5,088,520.00	0.12
37	601128	常熟银行	742,900	5,066,578.00	0.12
38	002065	东华软件	703,900	4,969,534.00	0.12
39	601186	中国铁建	503,100	4,955,535.00	0.12
40	601966	玲珑轮胎	222,700	4,948,394.00	0.12
41	600728	佳都科技	713,500	4,944,555.00	0.12
42	601601	中国太保	189,600	4,925,808.00	0.12
43	600048	保利发展	374,700	4,882,341.00	0.12
44	000338	潍柴动力	390,000	4,859,400.00	0.12
45	600863	内蒙华电	1,166,200	4,839,730.00	0.12
46	002025	航天电器	75,500	4,816,900.00	0.12
47	600161	天坛生物	176,840	4,801,206.00	0.12
48	601021	春秋航空	82,500	4,741,275.00	0.12
49	600582	天地科技	809,600	4,719,968.00	0.12
50	601688	华泰证券	340,600	4,690,062.00	0.11

51	600011	华能国际	499,400	4,624,444.00	0.11
52	600050	中国联通	954,400	4,581,120.00	0.11
53	601857	中国石油	607,800	4,540,266.00	0.11
54	300450	先导智能	125,400	4,535,718.00	0.11
55	600398	海澜之家	655,600	4,510,528.00	0.11
56	600258	首旅酒店	234,500	4,443,775.00	0.11
57	601555	东吴证券	635,600	4,411,064.00	0.11
58	601006	大秦铁路	592,600	4,403,018.00	0.11
59	601377	兴业证券	712,100	4,358,052.00	0.11
60	601111	中国国航	527,600	4,347,424.00	0.11
61	002625	光启技术	282,000	4,303,320.00	0.11
62	688002	睿创微纳	95,600	4,282,880.00	0.10
63	002500	山西证券	757,000	4,224,060.00	0.10
64	601717	郑煤机	338,700	4,216,815.00	0.10
65	000728	国元证券	644,100	4,199,532.00	0.10
66	601000	唐山港	1,182,400	4,173,872.00	0.10
67	600967	内蒙一机	411,900	4,160,190.00	0.10
68	600061	国投资本	576,900	4,107,528.00	0.10
69	601117	中国化学	493,700	4,087,836.00	0.10
70	002563	森马服饰	652,100	4,056,062.00	0.10
71	600528	中铁工业	406,800	4,019,184.00	0.10
72	600271	航天信息	290,000	3,970,100.00	0.10
73	600566	济川药业	136,100	3,952,344.00	0.10
74	601298	青岛港	563,000	3,924,110.00	0.10
75	000739	普洛药业	215,700	3,826,518.00	0.09
76	600941	中国移动	40,700	3,797,310.00	0.09
77	603883	老百姓	126,700	3,781,995.00	0.09
78	600901	江苏金租	913,780	3,773,911.40	0.09
79	002128	电投能源	279,600	3,696,312.00	0.09
80	300760	迈瑞医疗	12,000	3,597,600.00	0.09
81	600332	白云山	112,800	3,596,064.00	0.09

82	600170	上海建工	1,327,300	3,570,437.00	0.09
83	601728	中国电信	628,300	3,537,329.00	0.09
84	601618	中国中冶	866,100	3,438,417.00	0.08
85	601098	中南传媒	296,300	3,437,080.00	0.08
86	601333	广深铁路	799,200	3,164,832.00	0.08
87	600373	中文传媒	216,700	2,886,444.00	0.07
88	601816	京沪高铁	524,500	2,758,870.00	0.07
89	600862	中航高科	108,500	2,746,135.00	0.07
90	601669	中国电建	478,300	2,745,442.00	0.07
91	002152	广电运通	222,100	2,603,012.00	0.06
92	600085	同仁堂	44,900	2,584,444.00	0.06
93	600642	申能股份	351,900	2,459,781.00	0.06
94	600637	东方明珠	244,900	1,915,118.00	0.05
95	600027	华电国际	222,659	1,489,588.71	0.04
96	600329	达仁堂	11,739	526,963.71	0.01
97	301029	怡合达	140	6,255.20	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	300750	宁德时代	16,431,234.62	0.40
2	601318	中国平安	13,625,728.85	0.33
3	000568	泸州老窖	11,771,303.00	0.29
4	601398	工商银行	11,500,398.00	0.28
5	002304	洋河股份	10,935,990.00	0.27
6	600967	内蒙一机	10,832,568.00	0.26
7	600519	贵州茅台	10,675,213.00	0.26
8	601298	青岛港	9,905,757.00	0.24
9	601009	南京银行	9,852,714.00	0.24

10	600060	海信视像	9,710,239.61	0.24
11	002056	横店东磁	9,695,623.00	0.24
12	601319	中国人保	9,632,198.00	0.24
13	600919	江苏银行	9,470,698.00	0.23
14	600674	川投能源	9,465,801.00	0.23
15	600985	淮北矿业	9,416,407.00	0.23
16	600061	国投资本	8,662,010.00	0.21
17	601838	成都银行	8,591,119.00	0.21
18	601958	金钼股份	8,570,762.00	0.21
19	601618	中国中冶	7,818,153.00	0.19
20	601336	新华保险	7,786,263.00	0.19

注：“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	000568	泸州老窖	10,887,438.00	0.27
2	600985	淮北矿业	8,964,298.56	0.22
3	002966	苏州银行	7,886,707.00	0.19
4	002244	滨江集团	7,583,831.00	0.19
5	300009	安科生物	7,150,529.00	0.17
6	000012	南玻A	6,997,738.00	0.17
7	300861	美畅股份	6,977,291.00	0.17
8	600967	内蒙一机	6,578,895.00	0.16
9	601298	青岛港	6,568,717.00	0.16
10	603927	中科软	6,107,819.69	0.15
11	002273	水晶光电	6,020,421.00	0.15
12	603228	景旺电子	5,340,262.54	0.13
13	002384	东山精密	5,283,459.00	0.13

14	603355	莱克电气	5,224,980.50	0.13
15	600968	海油发展	5,008,302.00	0.12
16	002594	比亚迪	5,006,854.00	0.12
17	002129	TCL中环	4,989,896.00	0.12
18	002179	中航光电	4,987,259.54	0.12
19	002429	兆驰股份	4,950,385.00	0.12
20	601869	长飞光纤	4,819,704.00	0.12

注：“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	913,130,836.27
卖出股票收入（成交）总额	398,820,468.88

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,597,400,264.82	39.03
	其中：政策性金融债	1,128,014,016.39	27.56
4	企业债券	833,270,455.92	20.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	745,742,172.36	18.22
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	392,594,223.23	9.59
9	其他	-	-
10	合计	3,569,007,116.33	87.21

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	230203	23国开03	2,000,000	204,277,972.60	4.99
2	230201	23国开01	1,100,000	111,067,150.27	2.71
3	200203	20国开03	1,000,000	102,992,082.19	2.52
4	230205	23国开05	1,000,000	102,585,409.84	2.51
5	210303	21进出03	1,000,000	101,532,131.15	2.48

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

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金投资范围内包括国债期货。为规避市场风险，对本基金委托资产提供保护，本基金使用国债期货进行两类套期保值操作：1、现货替代；2、风险对冲。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内参与了国债期货投资，本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,015.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,015.67

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，投资组合报告中市值占净值比例的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 数	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

	(户)			比例		
路博迈护航一年持有债券A	12,815	176,526.11	214,509,436.58	9.48%	2,047,672,611.04	90.52%
路博迈护航一年持有债券C	10,774	169,904.42	23,291,497.07	1.27%	1,807,258,729.45	98.73%
合计	23,433	174,656.78	237,800,933.65	5.81%	3,854,931,340.49	94.19%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占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，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	路博迈护航一年持有债券A	3,122,438.57	0.1380%
	路博迈护航一年持有债券C	60,047.70	0.0033%
	合计	3,182,486.27	0.0778%

注：从业人员持有基金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，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	路博迈护航一年持有债券A	>100
	路博迈护航一年持有债券C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	路博迈护航一年持有债券A	0
	路博迈护航一年持有债券C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	路博迈护航一年持有债券A	路博迈护航一年持有债券C
基金合同生效日(2023年03月21日)基金份额总额	2,262,168,703.14	1,830,545,967.54
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	13,344.48	4,258.98
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	2,262,182,047.62	1,830,550,226.52

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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，基金管理人发生以下人事变动：

1、2023年3月10日，聘任魏晓雪女士担任公司副总经理。

2、2023年4月18日，聘任郭嘉令先生担任公司财务负责人，Patrick Song Liu先生不再兼任公司财务负责人。

3、2023年7月6日，Patrick Song Liu先生不再担任公司法定代表人、总经理，转任公司董事长。

4、2023年7月6日，阎小庆先生不再担任公司董事长，转任公司董事、法定代表人、总经理。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内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

本报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
东方证券	2	1,311,951,305.15	100.00%	1,019,647.78	100.00%	-

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

2、交易单元的选择标准和程序如下：

(1) 选择标准:

- ①公司实力雄厚，信誉良好；
- ②公司研究实力较强；
- ③公司财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ④公司经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- ⑤公司具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，可在确保合规与风险可控的前提下接入公司的信息系统，并能为基金提供全面的信息服务。

(2) 选择流程:

各相关部门按照合作意愿、研究服务、交易服务和运营能力对拟进行合作的证券公司进行打分后建立白名单，在白名单中选定合作的证券公司。

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
东方证券	653,270,335.87	100.00%	33,528,895,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2023-02-24
2	路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2023-02-24
3	路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2023-02-24

4	路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2023-02-24
5	路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-02-24
6	路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2023-02-24
7	路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2023-02-24
8	路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2023-03-22
9	路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金开放日常申购、赎回和定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2023-06-15
10	路博迈基金管理（中国）有限公司关于路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金参加部分销售机构费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023-06-15
11	路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金2023年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2023-07-21
12	路博迈基金管理（中国）有限公司旗下基金2023年第2季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-07-21

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集本基金的文件
- 2、本基金的基金合同
- 3、本基金的托管协议
- 4、本基金的招募说明书
- 5、本基金的各项公告
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、法律法规及中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所：上海市静安区石门一路288号香港兴业中心二座7楼705-710室

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人路博迈基金管理（中国）有限公司。

咨询电话：400 875 5888

公司网址：www.nbchina.com

路博迈基金管理（中国）有限公司

二〇二三年八月三十一日