

路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金  
2024 年第 1 季度报告

2024 年 03 月 31 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

报告送出日期：2024 年 04 月 22 日

## §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 4 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 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	2,657,610,301.72 份
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。
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

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	1,507,112,713.72 份	1,150,497,588.00 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 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 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
1. 本期已实现收益	-1,860,831.58	-3,264,012.49
2. 本期利润	12,571,822.92	8,303,367.91
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0057	0.0047
4. 期末基金资产净值	1,503,663,157.69	1,143,137,764.47
5. 期末基金份额净值	0.9977	0.9936

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	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	0.57%	0.12%	1.81%	0.12%	-1.24%	0.00%
过去六个月	0.21%	0.11%	2.44%	0.10%	-2.23%	0.01%
过去一年	-0.27%	0.10%	3.49%	0.09%	-3.76%	0.01%
自基金合同 生效起至今	-0.23%	0.10%	3.99%	0.09%	-4.22%	0.01%

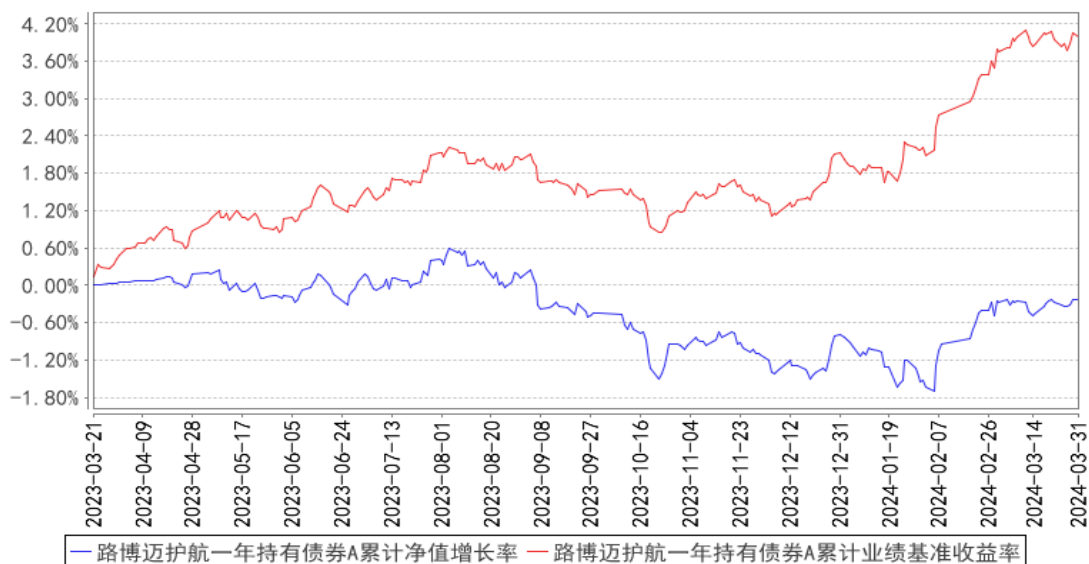
路博迈护航一年持有债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	--------	-------	-------	-------	-----	-----

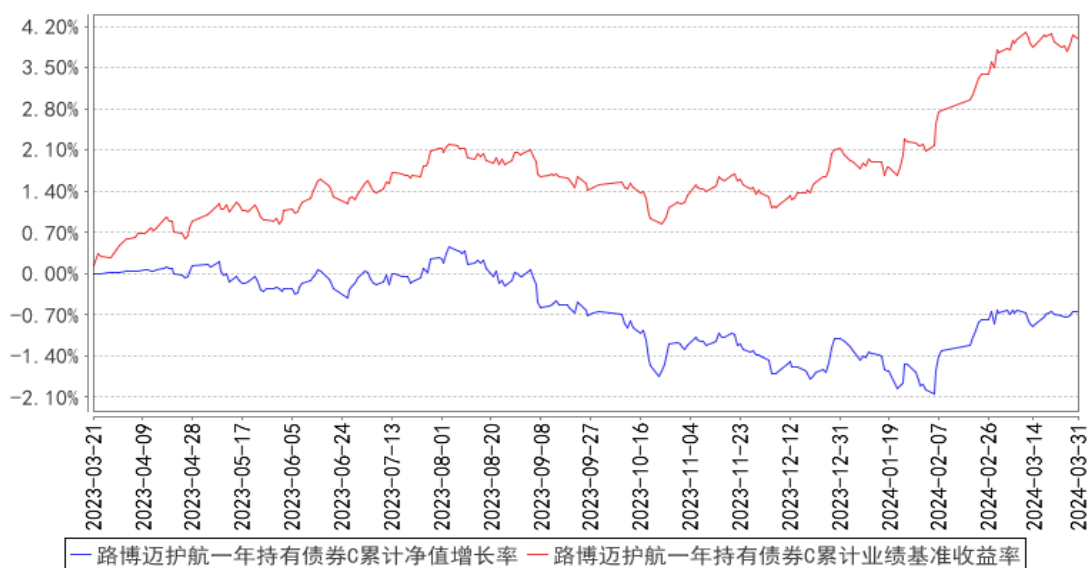
		标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	0.48%	0.12%	1.81%	0.12%	-1.33%	0.00%
过去六个月	0.01%	0.11%	2.44%	0.10%	-2.43%	0.01%
过去一年	-0.67%	0.10%	3.49%	0.09%	-4.16%	0.01%
自基金合同生效起至今	-0.64%	0.10%	3.99%	0.09%	-4.63%	0.01%

### 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

路博迈护航一年持有债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



路博迈护航一年持有债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同于 2023 年 3 月 21 日生效，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

## §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		
Ping Ru (汝平)	副总经理、基金经理	2023 年 3 月 21 日	-	12 年	Ping Ru (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 年 3 月 21 日	-	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。
魏晓雪	副总经理	2024 年 3 月 8 日	-	18 年	魏晓雪，中国国籍，复旦大学经济学硕

理、权益 CIO、基 金经理兼 投资经理	日			士。于 2022 年 10 月加入路博迈基金管理（中国）有限公司。现担任路博迈基金管理（中国）有限公司副总经理、权益 CIO、基金经理兼投资经理，分管公募股票投资部和研究部，兼公募股票投资部总经理及研究部总经理。曾任西南证券高级客户经理；鹏远（北京）管理咨询有限公司上海分公司研究员；光大保德信基金管理有限公司总经理助理、研究总监及基金经理。
-------------------------------	---	--	--	---

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

3、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。

#### 4.1.1 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
魏晓雪	公募基金	2	2,905,619,603.29	2023 年 06 月 16 日
	私募资产管理计划	2	65,985,053.86	2023 年 05 月 08 日
	其他组合	-	-	-
	合计	4	2,971,604,657.15	-

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本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的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为充分保护持有人利益，本基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。确保各基金在获得投研团队、交易团队支持等各方面得到公平对待。

本报告期内，各项公平交易制度流程均得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度，全球制造业 PMI 在荣枯线上持续上行，叠加美国商品库存回升，驱动国内出口景气度明显好于预期；国内需求则呈现明显分化态势，在外需回暖和政策驱动下，制造业和基建投资维持高速增长，但房地产投资依然延续深度负增长。总体来看，一季度国内经济维持弱增长态势，价格压力依然明显，融资需求有待改善。在此背景下，一季度长债利率下行为主，中枢回落至 2.3% 附近。一季度以来，债市主要经历了降准超预期落地、存款降息预期发酵、权益市场调整等利好，长债利率中枢从 2.55% 下行至 2.3% 附近。具体来看，1 月经济弱修复预期发酵叠加降准公告落地，长债利率震荡走低；2 月 LPR 非对称下调而存款降息预期抬升，资产荒影响下超长债大幅走强。3 月上旬以来，政府债供给压力、央行关注资金防空转等风险回升，市场整体多空力量均衡，长端利率低位波动。

展望来看，海外商品需求回暖大概率继续推动出口增速上行，大规模设备更新改造驱动下制造业投资有望维持高增长态势，广义财政加力也将助推基建保持较高增速，主要的不确定性在房地产销售和 investment 走势。总体来看，二季度国内经济增长环境有望温和改善，但内生需求增长动能的超季节性改善或相对有限；政府债供给可能贡献较多流动性缺口，但市场对于长久期高息资产的偏好或吸收部分供给冲击；息差压力下存款降息的可能性更高，而二季度配合超长期特别国债发行降准也可期待。后续长债利率或低位偏强震荡，中短久期票息策略或相对稳妥，但波动可能会明显加大。

一季度债券组合的主要操作是降低组合权益仓位，特别是大幅降低了可转债的仓位，在 3 月份基金开放期为应对赎回降低组合杠杆，同时维持组合久期。

股市方面，一季度 A 股和港股都先抑后扬。受量化私募产品遭遇流动性冲击以及“雪球”类结构化产品持续敲入的影响，年初至春节前小盘股跌幅巨大，连带大盘股也出现明显下跌。二月，市场稳定资金开始入市，以及 5 年期 LPR 的超预期调降等都有效地缓解了投资者的恐慌情绪。同时，股市大幅下跌后，投资价值也逐渐凸显，市场出现快速反弹。最终，A 股一季度小幅上涨，中证 800 指数微涨 1.56%，而港股继续下跌，恒生指数下跌 2.97%。

风格方面，本季度红利/价值风格继续大幅领先于成长风格，代表红利风格的中证红利指数涨幅超过 8%，而代表成长风格的创业板指数则下跌接近 4%。另一方面，本季度小盘股大幅跑输大盘股，代表小市值股票的中证 2000 指数在本季度跌超 11%，而代表大盘股的沪深 300 指数则涨超 3%。今年以来，红利风格延续了去年的强势，而小盘股则由强转弱。

行业方面，本季度上游能源、有色板块以及高分红的防御板块如银行、电力、交运、家电等有较高的正收益，而偏成长的 TMT、医疗以及房地产相关板块则下跌较多。上游资源股的大涨原因复杂，既有经济复苏，大宗商品价格走高的影响，也有地缘政治风险加剧，避险需求上升的因素。高分红板块的大涨则主要反映了低利率环境和低风险偏好下资金对确定性收益的追求。成长板块的下跌则主要与成长类公司的业绩增速大幅放缓以及投资者的风险偏好大幅下降有关。需要指出的是投资者的情绪经常在过度乐观与过度悲观之间大幅摇摆，在成长股上表现的尤为明显。比如创业板指数在一月大跌 16.81%，但在二月飙涨了 14.85%。房地产相关板块走弱的原因在于房地产销售依然疲弱，房地产开发企业的债务压力逐渐传导到行业内的领军企业，这进一步加剧了市场的担忧。尽管各种鼓励购房的政策先后推出，但在高库存以及购房者“买涨不买跌”的心理影响下，地产市场筑底反弹可能仍需一段时间。

具体投资策略方面，我们仍然坚持均衡配置的思路，既包括绝对收益导向的红利策略，也兼顾弹性较高的成长策略。红利策略已成为市场中比较受关注的策略，对于红利策略是否过热的担忧正在上升。我们认为只考虑股息率这一单一指标的红利策略是有风险的，投资者需要对红利股仔细甄别，更多关注股息的成长性和可持续性。成长策略方面，持续下跌显著提升优质成长股的预期收益。同时，我们也会关注市场当中的结构性机会。展望后市，我们谨慎乐观。尽管经济仍面临压力，但在低利率环境下 A 股和港股的估值都很有吸引力，企业的业绩会随着经济复苏而修复，投资者的信心也会随着市场反弹而恢复。

#### 4.5 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 0.9977 元，本报告期内净值增长率 0.57%，同期业绩比较基准收益率 1.81%；截至本报告期末，本基金 C 类份额净值 0.9936 元，本报告期内净值增长率 0.48%，同期业绩比较基准收益率 1.81%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	53,337,167.30	1.85
	其中：股票	53,337,167.30	1.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,592,024,794.89	89.99
	其中：债券	2,592,024,794.89	89.99
	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	133,000,000.00	4.62
	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	102,139,637.36	3.55
8	其他资产	995.22	0.00
9	合计	2,880,502,594.77	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 821,334.30 元，占期末基金资产净值比例为 0.03%。

## 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	5,916,475.00	0.22
C	制造业	24,597,374.00	0.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	7,652,000.00	0.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	11,529,600.00	0.44
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,513,944.00	0.06
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	1,306,440.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	52,515,833.00	1.98

## 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（%）
能源	821,334.30	0.03
合计	821,334.30	0.03

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 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	001965	招商公路	300,000	3,390,000.00	0.13
2	002233	塔牌集团	450,000	3,339,000.00	0.13
3	600600	青岛啤酒	36,000	3,001,320.00	0.11
4	000001	平安银行	280,000	2,945,600.00	0.11
5	300298	三诺生物	130,000	2,724,800.00	0.10
6	002088	鲁阳节能	180,000	2,709,000.00	0.10
7	601077	渝农商行	550,000	2,563,000.00	0.10
8	600028	中国石化	400,000	2,556,000.00	0.10
9	600309	万华化学	30,000	2,484,000.00	0.09
10	000725	京东方 A	600,000	2,436,000.00	0.09

## 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	128,075,904.43	4.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	656,356,777.05	24.80
	其中：政策性金融债	457,489,978.59	17.28
4	企业债券	727,872,968.23	27.50
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	988,149,810.59	37.33
7	可转债（可交换债）	91,569,334.59	3.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,592,024,794.89	97.93

## 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	200203	20 国开 03	1,400,000	142,511,125.68	5.38
2	230205	23 国开 05	1,000,000	104,495,123.29	3.95
3	200205	20 国开 05	1,000,000	103,825,041.10	3.92
4	230026	23 附息国债 26	900,000	93,446,010.99	3.53
5	102381301	23 中电投 MTN019	700,000	72,649,932.24	2.74

## 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国债期货交易情况说明

### 5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金国债期货投资策略将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控。

### 5.9.2 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（买/ 卖）	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-551,420.68
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

### 5.9.3 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，在本报告期末未持有国债期货。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

### 5.10.3 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	995.22
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	995.22

### 5.10.4 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	113066	平煤转债	4,324,710.82	0.16
2	113050	南银转债	4,102,665.53	0.16
3	113055	成银转债	3,722,370.53	0.14
4	110062	烽火转债	3,663,208.87	0.14
5	113044	大秦转债	3,594,092.47	0.14
6	128081	海亮转债	3,581,733.39	0.14
7	113061	拓普转债	3,577,554.66	0.14
8	128141	旺能转债	3,561,496.58	0.13
9	110083	苏租转债	3,147,395.34	0.12
10	113062	常银转债	3,102,396.90	0.12
11	110090	爱迪转债	3,062,480.48	0.12
12	127030	盛虹转债	2,783,596.30	0.11
13	123090	三诺转债	2,768,622.72	0.10
14	123194	百洋转债	2,689,495.28	0.10
15	127064	杭氧转债	2,547,438.36	0.10
16	118024	冠宇转债	2,311,419.00	0.09
17	113634	珀莱转债	2,247,135.53	0.08
18	111017	蓝天转债	2,212,589.12	0.08
19	128121	宏川转债	2,161,306.27	0.08
20	113045	环旭转债	2,035,360.00	0.08
21	123099	普利转债	1,941,192.07	0.07
22	127091	科数转债	1,900,350.00	0.07
23	123192	科思转债	1,893,197.34	0.07

24	127020	中金转债	1,883,480.12	0.07
25	123158	宙邦转债	1,863,031.29	0.07
26	113058	友发转债	1,831,108.41	0.07
27	123170	南电转债	1,632,712.52	0.06
28	127063	贵轮转债	1,553,133.03	0.06
29	123176	精测转 2	1,522,804.04	0.06
30	127050	麒麟转债	1,442,146.07	0.05
31	118030	睿创转债	1,436,523.37	0.05
32	118019	金盘转债	1,377,220.57	0.05
33	127037	银轮转债	1,364,713.21	0.05
34	118004	博瑞转债	1,343,419.20	0.05
35	113064	东材转债	1,227,813.00	0.05
36	113669	景 23 转债	1,223,432.85	0.05
37	118025	奕瑞转债	998,174.32	0.04
38	113667	春 23 转债	970,456.45	0.04
39	113060	浙 22 转债	809,224.80	0.03
40	127043	川恒转债	723,015.48	0.03
41	111011	冠盛转债	694,655.51	0.03

### 5.10.5 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。

### 5.10.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	路博迈护航一年持有债券 A	路博迈护航一年持有债券 C
报告期期初基金份额总额	2,265,591,347.30	1,830,843,508.67
报告期期间基金总申购份额	13,327,338.23	13,825.64
减：报告期期间基金总赎回份额	771,805,971.81	680,359,746.31
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	1,507,112,713.72	1,150,497,588.00

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。

## §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

项目	路博迈护航一年持有债券 A	路博迈护航一年持有债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	8,556,839.51	-
报告期期间买入/申购总份额	13,194,084.35	-
报告期期间卖出/赎回总份额	3,521,586.67	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	18,229,337.19	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	1.2096	-

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。

3、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，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额总额。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	申购	2024-03-12	13,194,084.35	13,159,460.32	-
2	赎回	2024-03-22	-3,521,586.67	-3,513,134.86	-
合计			9,672,497.68	9,646,325.46	

注：基金管理人申购、赎回本基金适用费率按照本基金招募说明书的费率执行，申购费用为固定费用 1000 元，赎回费用为 0。

## §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

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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## §9 备查文件目录

### 9.1 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

## 9.2 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

## 9.3 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](http://www.nbchina.com)

路博迈基金管理（中国）有限公司

2024 年 04 月 22 日