

博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

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:交通银行股份有限公司

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	4
§4 管理人报告	5
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	5
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	6
4.3 公平交易专项说明	6
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	7
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	8
§5 投资组合报告	8
5.1 报告期末基金资产组合情况	8
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	8
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	9
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	9
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	9
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	10
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	10
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	10
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	10
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	10
5.11 投资组合报告附注	10
§6 开放式基金份额变动	12
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	12
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	12
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	12
§8 影响投资者决策的其他重要信息	12
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	12
§9 备查文件目录	13
9.1 备查文件目录	13
9.2 存放地点	13
9.3 查阅方式	13

§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。

基金托管人交通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	博道中证同业存单AAA指数7天持有期
基金主代码	019037
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年10月24日
报告期末基金份额总额	111,603,522.33份
投资目标	本基金通过指数化投资，在尽量控制偏离度及跟踪误差的前提下，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为指数基金，在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。本基金将采用抽样复制和动态优化的方法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑投资标的的久期、流动性、基金日常申购赎回以及银行间和交易所成份券交易特性及交易惯例等情况进行优化，以保证对标的指数的有效跟踪。当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券和备选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券和备

	选成份券外寻找其他同业存单构建替代组合，对指数进行跟踪复制。本基金的债券投资策略和资产支持证券投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证同业存单AAA指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。同时，本基金为同业存单指数基金，主要投资于标的指数成份券及其备选成份券，具有与标的指数以及标的指数所代表的同业存单市场相似的风险收益特征。
基金管理人	博道基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

注：本基金对认/申购、转换转入的每份基金份额设定7天的最短持有期限，基金份额在最短持有期限内不办理赎回及转换转出业务，最短持有期限为持有期起始日（含）至持有期到期日（不含），自持有期到期日（含该日）起可以提出赎回或转换转出申请。

§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）
1.本期已实现收益	546,395.98
2.本期利润	505,473.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0039
4.期末基金资产净值	113,019,329.69
5.期末基金份额净值	1.0127

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

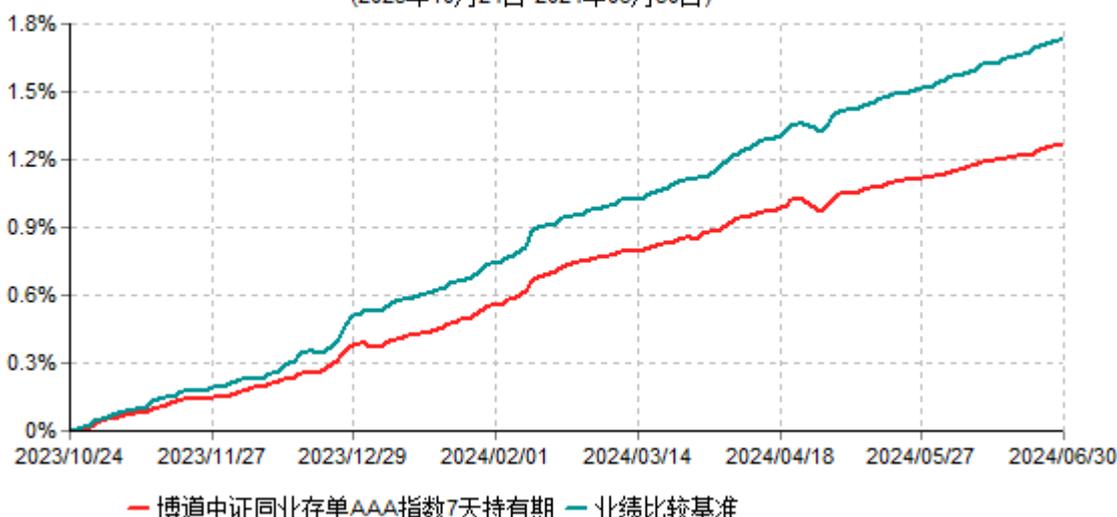
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④
----	--------	----------	----------	----------	-----	-----

		②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	0.39%	0.01%	0.60%	0.01%	-0.21%	0.00%
过去六个月	0.88%	0.01%	1.22%	0.01%	-0.34%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.27%	0.01%	1.73%	0.01%	-0.46%	0.00%

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

博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金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10月24日-2024年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2023年10月24日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未滿一年。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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	2023-10-24	-	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

	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			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，经济有所反复，股票市场在反弹之后再归平淡，避险情绪维持，债券市场与货币市场受支撑，十年期国债利率从2.29%下行至2.20%，一年期AAA同业存单利率从3月份的2.23%下行至1.95%，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。

本基金在二季度总体维持适中的久期，主要配置AAA级国有股份制大银行发行的同业存单品种。

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。

本基金将秉持勤勉尽责，力争为投资者获得长期可持续的投资收益。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	76,505,853.53	67.60
	其中：债券	76,505,853.53	67.60
	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	14,061,281.51	12.42
8	其他资产	22,610,037.50	19.98
9	合计	113,177,172.54	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
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）	-	-
8	同业存单	76,505,853.53	67.69
9	其他	-	-
10	合计	76,505,853.53	67.69

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	112420018	24广发银行CD018	80,000	7,993,265.76	7.07
2	112409010	24浦发银行CD010	80,000	7,921,712.92	7.01
3	112304020	23中国银行CD020	70,000	6,994,479.96	6.19
4	112302049	23工商银行CD049	70,000	6,957,107.21	6.16
5	112406054	24交通银行CD054	70,000	6,920,079.01	6.12

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 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，24广发银行CD018（证券代码112420018）为本基金持有的前十大证券。2023年8月3日，发行主体广发银行股份有限公司因小微企业划型不准确等14项主要违法违规事实，被国家金融监督管理总局罚款合计2340万元（金罚决字〔2023〕5号），其中，总行550万元，分支机构1790万元。

截至本报告期末，23中国银行CD020（证券代码112304020）为本基金持有的前十大证券。2023年11月29日，发行主体中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）因违反账户管理规定等12项违法行为收到中国人民银行警告，没收违法所得37.340315万元，罚款3664.2万元的行政处罚（银罚决字〔2023〕93号）。2023年12月28日，中国银行因部分重要信息系统识别不全面，灾备建设和灾难恢复能力不符合监管要求等9项违法违规事实，收到国家金融监督管理总局罚款430万元的行政处罚（金罚决字〔2023〕68号）。2024年4月3日，中国银行因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查，收到国家外汇管理局北京市分局处40万元人民币罚款，没收违法所得2236.13元人民币的行政处罚（京汇罚〔2024〕9号）。

截至本报告期末，24交通银行CD054（证券代码112406054）为本基金持有的前十大证券。2024年6月3日，发行主体交通银行股份有限公司因安全测试存在薄弱环节等4项违法违规事实，收到国家金融监督管理总局罚款160万元的行政处罚（金罚决字〔2024〕29号）。

截至本报告期末，24建设银行CD148（证券代码112405148）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中信银行CD201（证券代码112308201）为本基金持有的前十大证券。2023年11月16日，发行主体中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）因违反高管准入管理相关规定等56项主要违法违规事实，国家金融监督管理总局对中信银行总行罚款15242.59万元、没收违法所得462.59万元，对分支机构罚款6770万元，罚没合计22475.18万元（金罚决字〔2023〕15号）。2023年12月29日，中信银行因部分重要信息系统应认定未认定，相关系统未建灾备或灾难恢复能力不符合监管要求等6项主要违法违规事实，被国家金融监督管理总局罚款400万元（金罚决字〔2023〕69号）。

截至本报告期末，24平安银行CD020（证券代码112411020）为本基金持有的前十大证券。2023年7月7日，发行主体平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）因违反账户管理规定等10项违法行为收到中国人民银行警告，没收违法所得1848.67元，罚款3492.5万元的行政处罚（银罚决字〔2023〕55号）。2023年12月12日，平安银行因考评机制不当，贷款业务操作不规范，小微企业划型不准确，收到国家金融监督管理总局深圳监管局罚款170万元的行政处罚（深金罚决字〔2023〕69号）。2023年12月19日，平安银行因存在利用赠送基金份额形式开展基金销售业务的情况，被深圳证监局采取出具警示函行政监管措施（行政监管措施决定书〔2023〕264号）。2024年5月14日，平安银行因公司治理与内部控制等五个方面存在违法违规事实，收到国家金融监督管理总局没收违法所得并处罚款合计6723.98万元的行政处罚（金罚决字〔2024〕6号），其中，总行6073.98万元，分支机构650万元。

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	22,610,037.50
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	22,610,037.50

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

报告期期初基金份额总额	91,074,315.56
报告期期间基金总申购份额	203,092,760.32
减：报告期期间基金总赎回份额	182,563,553.55
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	111,603,522.33

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

本基金管理人本报告期末未持有本基金。

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	20240415-20240617	-	59,429,477.80	59,429,477.80	-	-
产品特有风险							
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。							

§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中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道中证同业存单AAA指数7天持有期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、报告期内博道中证同业存单AAA指数7天持有期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）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