

路博迈中国机遇混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 1 月 1 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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
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 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	48

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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	路博迈中国机遇混合型证券投资基金	
基金简称	路博迈中国机遇混合	
基金主代码	018424	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 06 月 16 日	
基金管理人	路博迈基金管理（中国）有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	255,473,747.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	路博迈中国机遇混合 A	路博迈中国机遇混合 C
下属分级基金的交易代码	018424	018425
报告期末下属分级基金的份额总额	151,462,410.08 份	104,011,337.44 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格风险控制的基础上，通过深入的个股研究出发，挑选有长期发展潜力的上市公司，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金为偏股混合型基金。投资策略主要包括资产配置策略、股票及港股通标的股票投资策略、债券投资策略、可转换债券（含分离交易可转债）和可交换债券投资策略、流动性管理策略、衍生产品投资策略以及参与融资业务的投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*70%+中债新综合财富（总值）指数收益率*20%+恒生指数收益率（经人民币汇率调整）*10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险及预期收益水平理论上高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林海中
	联系电话	021-32063717
	电子邮箱	haizhong.lin@nbchina.com
客户服务电话	4008755888	95588
传真	021-32063700	(010) 66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世	北京市西城区复兴门内大街 55

	纪大道 88 号 30 层 11 单元	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 55 号
邮政编码	200041	100140
法定代表人	阎小庆	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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）有限公司	中国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

§ 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	路博迈中国机遇混合 A	路博迈中国机遇混合 C
本期已实现收益	3,934,863.34	2,392,781.06
本期利润	-6,159,455.80	-5,151,931.30
加权平均基金份额 本期利润	-0.0386	-0.0418
本期加权平均净 值利润率	-4.23%	-4.60%
本期基金份额净 值增长率	-3.73%	-4.01%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-15,865,951.99	-11,469,307.41
期末可供分配基 金份额利润	-0.1048	-0.1103

期末基金资产净值	135,596,458.09	92,542,030.03
期末基金份额净值	0.8952	0.8897
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-10.48%	-11.03%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

路博迈中国机遇混合 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	-5.04%	0.78%	-2.95%	0.41%	-2.09%	0.37%
过去三个月	-3.35%	0.90%	-1.30%	0.64%	-2.05%	0.26%
过去六个月	-3.73%	1.07%	-0.03%	0.80%	-3.70%	0.27%
过去一年	-11.33%	0.85%	-8.13%	0.74%	-3.20%	0.11%
自基金合同生效起至今	-10.48%	0.84%	-9.73%	0.74%	-0.75%	0.10%

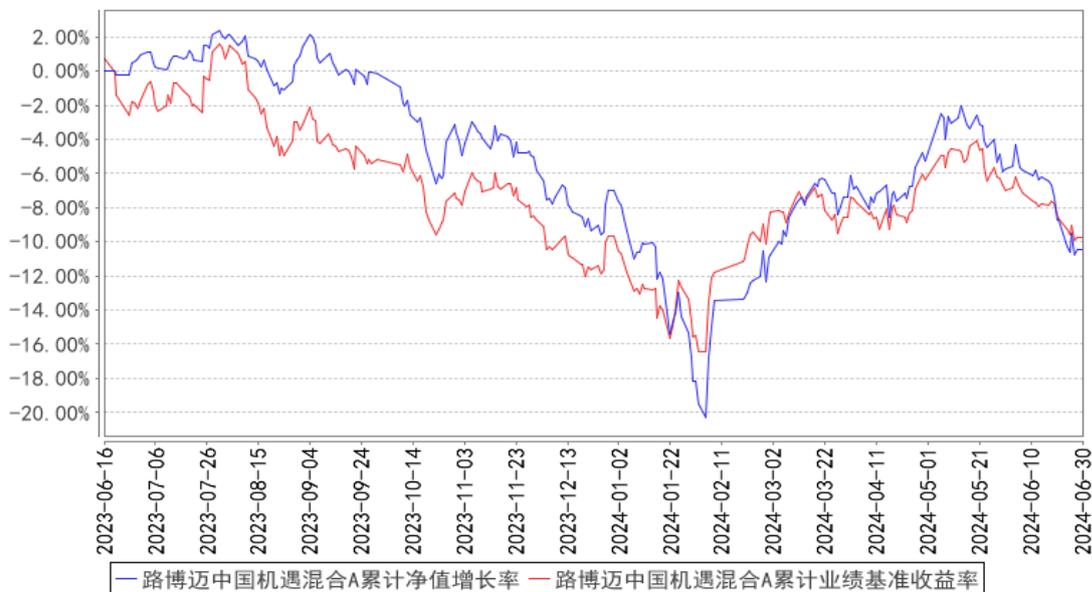
路博迈中国机遇混合 C

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	-5.08%	0.78%	-2.95%	0.41%	-2.13%	0.37%
过去三个月	-3.48%	0.90%	-1.30%	0.64%	-2.18%	0.26%
过去六个月	-4.01%	1.07%	-0.03%	0.80%	-3.98%	0.27%
过去一年	-11.86%	0.86%	-8.13%	0.74%	-3.73%	0.12%

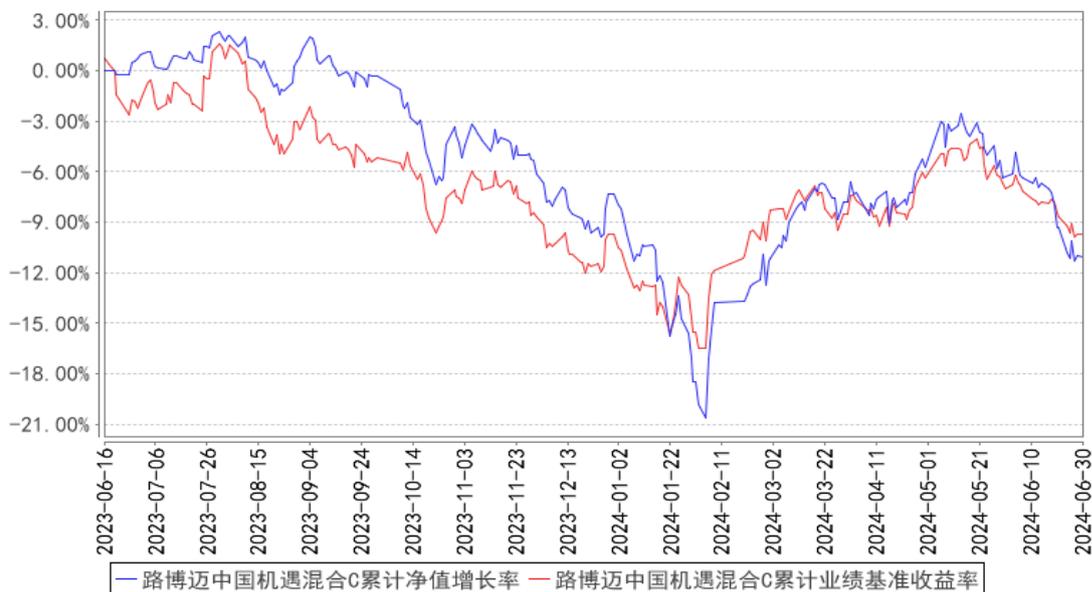
自基金合同生效 起至今	-11.03%	0.84%	-9.73%	0.74%	-1.30%	0.10%
----------------	---------	-------	--------	-------	--------	-------

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

路博迈中国机遇混合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



路博迈中国机遇混合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 6 月 16 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 6 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、路博迈中国绿色债券债券型证券投资基金、路博迈中国医疗健康股票型发起式证券投资基金、路博迈中国精选利率债债券型证券投资基金、路博迈安航 90 天持有期债券型证券投资基金。

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		
魏晓雪	副总经理、权益 CIO、基金经理兼投资经理	2023 年 6 月 16 日	-	18 年	魏晓雪，中国国籍，复旦大学经济学硕士。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。

4.1.3 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

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	1,323,212,176.53	2023 年 6 月 16 日

私募资产管理计划	2	61,520,184.48	2023年5月8日
其他组合	-	-	-
合计	4	1,384,732,361.01	-

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 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，基金经理严格遵守公平、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

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 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

国内方面，2024 年一季度资本市场对宏观经济增长的预期出现了从悲观向复苏的修正。由于 2023 年四季度房价快速下降，地方政府化债压力较大，而稳增长政策效果显现较慢，CPI 同比仍负增，市场存在较强烈的通缩预期。而 2024 年 1-2 月经济数据好于预期，工业增加值、出口、社零及制造业投资增速均好于预期，3 月制造业 PMI 更是超预期回升至 50 荣枯线以上。开年经济超预期，一方面是全球贸易回暖，国内出口改善，带动制造业生产出现回暖的效果，1-2 月我国美元计价出口增长 7.1%，高于 Wind 一致预期 0.3%。3 月出口改善仍在持续，制造业 PMI 的出口新订

单指数环比大幅回升 5 个点，达到 51.3%，自 23 年 3 月以来首次重回荣枯线上。韩国和越南出口向好也释放了全球贸易回暖信号。另一方面则可能是前期稳增长的政策效果，带动了基建和财政支出增速回升。从基本面来看，经济开门红后，二季度仍有韧性，不会像去年二季度一样快速走弱，出口向好有一定的持续性，后续设备更新改造投资和“三大工程”的带动作用也值得关注。

政策方面，2024 年两会释放了较强的宽财政的预期，全年赤字率拟按 3% 安排，赤字规模比上年年初预算增加 1800 亿元。一般公共预算支出规模比上年增长 1.1 万亿元，并表示将连续几年发行超长期特别国债，今年先发行 1 万亿元。同时，新质生产力是今年两会的重中之重，未来可能有一系列产业政策出台，有利于资本市场信心提振。

海外方面，美国经济维持韧性，新增就业持续修复，薪资增速稳定，居民实际收入持续改善，企业端盈利强劲，非住宅投资高增势头不减。降息的内生紧迫性不足，年内 75bp 降息预期仍存在一定下调风险。另一方面，在地缘因素频发的环境中，全球供应链风险和制造业格局重塑导致更高的通胀中枢。3 月议息会议中，美联储罕见调升长期利率水平至 2.6%，显示在制造业竞争力改善、海外劳动力输入影响下，美国长期利率中枢提升，而美长期通胀中枢也或有所提升。

2024 年二季度，国内方面，从 4-5 月的经济数据来看，在一季度经济实现开门红之后，二季度经济产需有所走弱。在生产端，服务业生产指数在一季度的 5.5% 基础上，4、5 月分别下降至 3.5% 和 4.8%，显示出一定的疲软。而工业增加值增速企稳，4-5 月保持在 6.1% 左右。在需求端，出口得益于低基数，从一季度的 1.4% 增长至 4-5 月的 4.5%，显示出较强的韧性。然而，固定资产投资增速因房地产市场下行拖累和基建投资的波动，从一季度的 4.5% 下降至 4-5 月的 3.4%。社会消费品零售总额增速也有所放缓，从一季度的 4.7% 降至 4-5 月的 3%。整体而言，二季度房地产体现出更大的压力，政策虽转向，但保交房任务艰巨，市场期待更多政策支持。居民信贷需求不振、汽车零售额负增，当前消费者信心不足。经济仍处在调结构的转型期，经济复苏的基础尚不稳固，二季度 GDP 同比增速将从一季度的 5.3% 减速至 5% 左右，GDP 平减指数可能仍落在负值区间。

政策方面，财政政策的效果可能很难在二季度体现，虽然 5 月地方专项债发行速度有所加快，但截止 5 月整体进度仍偏低，更多的财政发力可能在下半年。地产方面则推出了 3000 亿元保障性住房再贷款，取消商业性个人住房贷款利率政策下限，下调公积金贷款利率等措施缓解地产市场的下行压力，目前对“量”的效果好于“价”，持续性还待观察。随着 7 月三中全会召开，市场关注的财税体制改革、发展新质生产力等政策可能会更加清晰。

海外方面，美国经济和通胀均维持了较强的韧性，新增非农就业仍较低，初次申请失业金人数仍也处于低位，短期看，股市上涨带来居民财富效应，使得本轮美国居民的资产负债表也比较健康。另一方面，在地缘因素频发的环境中，全球供应链风险和制造业格局重塑导致更高的通胀

中枢。24 年美联储的降息次数也从此前的 3 次下降到 1-2 次。考虑到中美利差处在历史高位，这也制约了国内货币政策的降息操作，对新兴市场流动性带来一定不利影响。

2024 年一季度 A 股市场呈现了大幅下跌后反弹的走势，成长风格剧烈下跌，红利风格大放异彩。一季度以价值为代表的上证 50 和红利指数，涨幅分别为 3.8%和 10.1%，以成长为代表的创业板指和科创 50 分别下跌了 3.85%和 10.47%。沪深 300、上证综指及中小综指分别实现了 3.1%、2.23%及-5.95%的收益率。

从行业分布来看，一季度表现最好的行业是石油石化、家电、银行及煤炭有色。其中，石油石化行业单季度涨幅超过 12%。表现较弱的是以成长风格为代表的医药、电子、地产以及计算机，其中电子和医药的单季度跌幅均在 10%以上。行业间的二级市场表现极致分化。

2024 年二季度除了红利指数微涨以外，A 股市场呈现了普跌走势，风格上偏成长偏小市值板块跌幅更大。二季度以价值为代表的上证 50 和红利指数，涨跌幅分别为-0.83%和 1.06%，以成长为代表的创业板指和科创 50 分别下跌了 7.41%和 6.64%。沪深 300、上证综指及中小综指分别实现了-2.14%、-2.43%及-6.45%的收益率。

从行业分布来看，二季度表现最好的行业是银行、公共事业和交通运输。其中，银行行业单季度涨幅超过 7%，上半年银行行业涨幅超过 19%。表现较弱的是以成长和内需为代表的餐饮旅游、传媒、商贸零售、计算机和轻工、食品饮料，其中餐饮旅游的单季度跌幅在 20%以上。行业间的二级市场表现极致分化。

本基金一季度的操作中，仓位维持中性偏谨慎，持仓结构偏向于均衡，增配了上游资源类公司的部署，维持了今年在人民币贬值背景下较为受益的出口相关的消费行业。对于持仓公司的分红率进行了梳理，更为偏好愿意主动提升分红率且估值尚在低位的个股。二季度的操作中，仓位略微提升至中性偏高的仓位，持仓结构偏向于均衡。由于红利方面的持仓更偏向于内需而非金融，股价表现相对低于预期。维持了今年在人民币贬值背景下较为受益的出口相关的消费行业，也维持了对于上游资源类公司的配置，同时逐步增加了中国经济转型的大背景下，以高端制造升级、汽车及电动车的产业发展、AI 技术浪潮带来的科技机会等成长属性较强的投资机会。本基金在个股选择上始终坚持综合评估企业的盈利能力、成长性和估值水平。

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 0.8952 元，本报告期内净值增长率-3.73%，同期业绩比较基准收益率-0.03%；截至本报告期末，本基金 C 类份额净值 0.8897 元，本报告期内净值增长率-4.01%，同期业绩比较基准收益率-0.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来更长的 2-3 年，我们依然坚持认为从长期视角来看，中国权益市场中结构性低估资产依然存在，市场参与者结构愈发成熟，优质资产的稀缺性依然在，大的投资机会不断涌现，权益资产在大类资产配置中依然非常值得重视。

具体展望 2024 年下半年，我们认为国内经济仍然处在新旧动能转换的阵痛期，需要重点解决内需不足、预期偏弱的问题。但政策存在改革、高质量发展、稳增长等多重目标，在消化地产对经济的负面拖累过程中，难免存在掣肘，这使得经济从筑底到企稳的过程更加复杂。疫情以来，居民资产负债表受损，边际面临就业及收入改善趋缓的影响；国内产能存在过剩问题，“需求—投资”循环尚需畅通；上半年价格改善有限，实际利率高位。相对有利的是，下半年政策基调更加重视“总量”，阶段性的托底政策可能增加。预计全年 GDP 增速小幅下滑，市场核心还是在于新一轮政策发力能否有效抵御基本面下行压力。

需求偏弱及产能过剩下，国内价格指数回升还存在一定压力。基数效应下，PPI、CPI 预计前低后高，但转正的时间滞后于年初以来的预期。预计 PPI 从一季度-2.7%小幅回升至年末的-0.8%，CPI 从-0.3%小幅回升至 0.8%。

政策及流动性方面，7 月中央经济工作会议确定了偏积极的政策基调，24 年二季度以来，外部环境带来的不利因素增多，下半年需要更多政策发力才能完成全年经济增长目标。加快专项债发行，用好超长期特别国债，更大力度推动大规模设备更新和大宗耐用消费品以旧换新等，下半年财政政策有望更加“给力”；而随着美联储在四季度可能开始降息，国内货币政策也有更大的腾挪空间，总体来看，下半年的政策发力力度可能高于上半年。

未来经济的主要风险包含：国内地产价格继续下滑、国内宽财政政策不及预期、地缘政治风险升温以及海外流动性反复的风险。

降息前景方面，9 月降息已经进入深入讨论范围，三季度存在降息交易的可能。不过今年的降息，更多是预防性的，降息后可能存在 1 个季度左右的观察窗口期，目前的经济数据尚不支持连续降息。24 年还存在美国、俄罗斯等多个大国的选举，在逆全球化趋势之下，可能带来较多地缘政治风险，需密切关注形势发展，警惕是否会触发包括贸易在内的多重风险。

综上所述，面对日益复杂的市场环境，中国机遇基金依然坚持长期投资和价值投资理念，且在股价涨跌的过程中，考虑估值波动而不断调整持仓比重。在基金的操作中，我们会加大自下而上的选股方式，始终坚持综合评估企业的盈利能力、成长性和估值水平。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人——路博迈基金管理（中国）有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对路博迈基金管理（中国）有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：路博迈中国机遇混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,598,460.49	896,621.72
结算备付金		0.01	4.49
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	193,532,250.76	254,540,950.98
其中：股票投资		179,156,484.37	234,235,444.02
基金投资		-	-
债券投资		14,375,766.39	20,305,506.96
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	33,502,526.96	40,094,028.64
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		161,392.00	-
应收申购款		29,727.28	2,613,381.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		228,824,357.50	298,144,987.63
负债和净资产			
		本期末	上年度末
		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 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		66,342.57	147,622.91
应付管理人报酬		236,126.34	307,016.63
应付托管费		39,354.40	51,169.42
应付销售服务费		48,587.24	71,533.92
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,204.46	3,487.67
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.6	294,254.37	85,000.00
负债合计		685,869.38	665,830.55
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	255,473,747.52	320,377,508.83
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-27,335,259.40	-22,898,351.75
净资产合计		228,138,488.12	297,479,157.08
负债和净资产总计		228,824,357.50	298,144,987.63

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 255,473,747.52 份，其中 A 类基金份额净值 0.8952 元，基金份额 151,462,410.08 份；C 类基金份额净值 0.8897 元，基金份额 104,011,337.44 份。

6.2 利润表

会计主体：路博迈中国机遇混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 6 月 16 日（基金 合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-9,091,308.67	4,464,330.74
1. 利息收入		328,003.09	134,893.37
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,826.48	23,693.58
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		321,176.61	111,199.79
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,996,600.16	-139,427.91
其中：股票投资收益	6.4.7.10	4,132,638.61	-139,133.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	515,730.31	-443.16
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	3,348,231.24	149.14
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)	6.4.7.15	-17,639,031.50	4,468,865.28
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	223,119.58	-
减：二、营业总支出		2,220,078.43	352,964.04
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,536,587.83	249,020.26
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	256,097.92	41,503.37
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	334,133.66	55,632.99
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	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		1,157.10	400.32
8. 其他费用	6.4.7.18	92,101.92	6,407.10
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-11,311,387.10	4,111,366.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-11,311,387.10	4,111,366.70
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-11,311,387.10	4,111,366.70

注：本基金合同生效日为 2023 年 6 月 16 日，本期财务报表的上年度可比期间为 2023 年 6 月 16 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日止。

6.3 净资产变动表

会计主体：路博迈中国机遇混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 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	320,377,508.83	-	-22,898,351.75	297,479,157.08
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	320,377,508.83	-	-22,898,351.75	297,479,157.08
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-64,903,761.31	-	-4,436,907.65	-69,340,668.96
(一)、综合收益总额	-	-	-11,311,387.10	-11,311,387.10
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-64,903,761.31	-	6,874,479.45	-58,029,281.86
其中：1. 基金申购款	66,605,795.22	-	-4,463,465.37	62,142,329.85
2. 基金赎回款	-	-	11,337,944.82	-120,171,611.71
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	255,473,747.52	-	-27,335,259.40	228,138,488.12
项目	上年度可比期间			
	2023年6月16日(基金合同生效日)至2023年6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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	432,776,376.82	-	-	432,776,376.82

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	4,111,366.70	4,111,366.70
(一)、综合收益总额	-	-	4,111,366.70	4,111,366.70
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	432,776,376.82	-	4,111,366.70	436,887,743.52

注：本基金合同生效日为 2023 年 6 月 16 日，本期财务报表的上年度可比期间为 2023 年 6 月 16 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日止。

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

基金管理人负责人

阎小庆

主管会计工作负责人

黄恩典

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

路博迈中国机遇混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2023 年 4 月 18 日证监许可【2023】830 号《关于准予路博迈中国机遇混合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《中华人民共和国证券投资基金法》、《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《路博迈中国机遇混合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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。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 6 月 16 日正式生效，生效日的基金份额总额为 432,776,376.82 份，其中 A 类份额总额 191,051,242.54 份，C 类基金份额总额 241,725,134.28 份，经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验字第 2300624 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、科创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、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债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、股指期货、股票期权、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具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）。本基金可根据法律法规和基金合同的约定，参与融资融券业务中的融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准：中证 800 指数收益率*70%+中债新综合财富（总值）指数收益率*20%+恒生指数收益率（经人民币汇率调整）*10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况、自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本基金本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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[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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81号文《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[2016]127号文《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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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]140号文《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号文《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》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81号《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[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红

利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税

b) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

对内地个人投资者通过沪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。内地个人投资者通过沪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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	1,361,522.06
等于：本金	1,361,367.27
加：应计利息	154.79
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	236,938.43
等于：本金	236,783.04
加：应计利息	155.39
减：坏账准备	-
合计	1,598,460.49

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 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	207,509,341.98	-	179,156,484.37	- 28,352,857.61	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	4,051,545.00	18,100.82	4,031,700.82	-37,945.00
	银行间市场	10,124,670.00	341,065.57	10,344,065.57	-121,670.00
	合计	14,176,215.00	359,166.39	14,375,766.39	-159,615.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	221,685,556.98	359,166.39	193,532,250.76	- 28,512,472.61	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	33,502,526.96	-
银行间市场	-	-
合计	33,502,526.96	-

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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	19,890.78
预提费用-信息披露费	109,672.34
其他应付	164,691.25
合计	294,254.37

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

路博迈中国机遇混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	172,950,651.56	172,950,651.56
本期申购	23,001,795.35	23,001,795.35

本期赎回(以“-”号填列)	-44,490,036.83	-44,490,036.83
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	151,462,410.08	151,462,410.08

路博迈中国机遇混合 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	147,426,857.27	147,426,857.27
本期申购	43,603,999.87	43,603,999.87
本期赎回(以“-”号填列)	-87,019,519.70	-87,019,519.70
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	104,011,337.44	104,011,337.44

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

单位：人民币元

路博迈中国机遇混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,748,850.38	-5,367,590.52	-12,116,440.90
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	3,934,863.34	-10,094,319.14	-6,159,455.80
本期基金份额交易产生的变动数	750,163.36	1,659,781.35	2,409,944.71
其中：基金申购款	-946,680.36	-739,887.03	-1,686,567.39
基金赎回款	1,696,843.72	2,399,668.38	4,096,512.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,063,823.68	-13,802,128.31	-15,865,951.99

路博迈中国机遇混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,215,318.78	-4,566,592.07	-10,781,910.85
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-

本期利润	2,392,781.06	-7,544,712.36	-5,151,931.30
本期基金份额交易产生的变动数	1,778,914.61	2,685,620.13	4,464,534.74
其中：基金申购款	-1,973,424.87	-803,473.11	-2,776,897.98
基金赎回款	3,752,339.48	3,489,093.24	7,241,432.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,043,623.11	-9,425,684.30	-11,469,307.41

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		4,497.59
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		2,328.86
结算备付金利息收入		0.03
其他		-
合计		6,826.48

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

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		4,132,638.61
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		4,132,638.61

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		244,346,166.28
减：卖出股票成本总额		239,702,885.08
减：交易费用		510,642.59
买卖股票差价收入		4,132,638.61

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	235,687.96
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	280,042.35
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	515,730.31

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,415,529.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,970,496.00
减：应计利息总额	164,360.85
减：交易费用	630.69
买卖债券差价收入	280,042.35

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 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,348,231.24
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,348,231.24

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-17,639,031.50
股票投资	-17,552,982.50
债券投资	-86,049.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-17,639,031.50

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	223,119.58
合计	223,119.58

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,138.80
账户维护费_中债登	9,000.00

开户费	400.00
合计	92,101.92

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

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

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

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 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年6月16日（基金 合同生效日）至2023年6

		月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,536,587.83	249,020.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	766,784.79	123,876.44
应支付基金管理人的净管理费	769,803.04	125,143.82

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 6 月 16 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	256,097.92	41,503.37

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	路博迈中国机遇混合 A	路博迈中国机遇混合 C	合计
中国工商银行股份有限公司	-	24,629.10	24,629.10
合计	-	24,629.10	24,629.10
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 6 月 16 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	路博迈中国机遇混合 A	路博迈中国机遇混合 C	合计
中国工商银行股份有限公司	-	840.56	840.56
合计	-	840.56	840.56

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 0.60% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年6月16日（基金合同生效日）至 2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,361,522.06	4,497.59	12,001,949.71	22,983.22

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301589	诺瓦星云	2024年02月01日	6个月	创业板打新限售	70.47	188.33	569	40,097.24	107,159.77	-
603350	安乃达	2024年06月26日	1个月内（含）	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603285	键邦股份	2024年06月28日	1个月内（含）	新股未上市	18.65	18.65	994	18,538.10	18,538.10	-
688692	达梦数据	2024年06月04日	6个月	科创板打新限售	86.96	209.54	81	7,043.76	16,972.74	-
301536	星辰科技	2024年03月20日	6个月	创业板打新限售	16.16	32.26	428	6,916.48	13,807.28	-
301538	骏鼎达	2024年03月13日	6个月	创业板打新限售	40.09	91.22	149	5,972.74	13,591.78	-
301392	汇成真空	2024年05月28日	6个月	创业板打新限售	12.20	55.87	219	2,671.80	12,235.53	-
688691	灿芯股份	2024年04月02日	6个月	科创板打新限售	19.86	49.38	247	4,905.42	12,196.86	-
301565	中仑新材	2024年06月13日	6个月	创业板打新限售	11.88	23.32	510	6,058.80	11,893.20	-

301580	爱迪特	2024年06月19日	6个月	创业板打新限售	44.95	74.00	141	6,337.95	10,434.00	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	创业板打新限售	8.90	16.75	576	5,126.40	9,648.00	-
301539	宏鑫科技	2024年04月03日	6个月	创业板打新限售	10.64	24.30	361	3,841.04	8,772.30	-
688709	成都华微	2024年01月31日	6个月	科创板打新限售	15.69	18.77	464	7,280.16	8,709.28	-
001389	广合科技	2024年03月26日	6个月	新股锁定	17.43	42.03	205	3,573.15	8,616.15	-
301591	肯特股份	2024年02月20日	6个月	创业板打新限售	19.43	36.92	219	4,255.17	8,085.48	-
301587	中瑞股份	2024年03月27日	6个月	创业板打新限售	21.73	27.10	288	6,258.24	7,804.80	-
688530	欧莱新材	2024年04月29日	6个月	科创板打新限售	9.60	18.96	344	3,302.40	6,522.24	-
601033	永兴股份	2024年01月11日	6个月	新股锁定	16.20	15.95	387	6,269.40	6,172.65	-
688695	中创股份	2024年03月06日	6个月	科创板打新限售	22.43	31.54	186	4,171.98	5,866.44	-
301588	美新科技	2024年03月06日	6个月	创业板打新限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-

301502	华阳智能	2024年01月26日	6个月	创业板打新限售	28.01	37.81	138	3,865.38	5,217.78	-
603341	龙旗科技	2024年02月23日	6个月	新股锁定	26.00	37.47	120	3,120.00	4,496.40	-
001359	平安电工	2024年03月19日	6个月	新股锁定	17.39	20.61	168	2,921.52	3,462.48	-
603082	北自科技	2024年01月23日	6个月	新股锁定	21.28	29.48	107	2,276.96	3,154.36	-
603375	盛景微	2024年01月17日	6个月	新股锁定	38.18	38.88	72	2,748.96	2,799.36	-
603325	博隆技术	2024年01月03日	6个月	新股锁定	72.46	68.02	41	2,970.86	2,788.82	-
603344	星德胜	2024年03月13日	6个月	新股锁定	19.18	22.66	122	2,339.96	2,764.52	-
001387	雪祺电气	2024年01月04日	6个月	新股锁定	11.82	15.23	173	2,045.54	2,634.79	-
001379	腾达科技	2024年01月11日	6个月	新股锁定	16.98	13.48	195	3,311.10	2,628.60	-
603381	永臻股份	2024年06月19日	6个月	新股锁定	23.35	26.59	95	2,218.25	2,526.05	-
603312	西典新能	2024年01月04日	6个月	新股锁定	29.02	25.34	96	2,785.92	2,432.64	-

603350	安乃达	2024年06月26日	6个月	新股锁定	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603285	键邦股份	2024年06月28日	6个月	新股锁定	18.65	18.65	111	2,070.15	2,070.15	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金为混合型基金，其预期风险及预期收益水平理论上高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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等。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、风控负责人、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、风控负责人、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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	8,114,378.08
合计	-	8,114,378.08

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。

3、未评级债券为国债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	1,960,128.88
未评级	14,375,766.39	10,231,000.00
合计	14,375,766.39	12,191,128.88

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。

3、未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,598,460.49	-	-	-	1,598,460.49
结算备付金	0.01	-	-	-	0.01
交易性金融资产	14,375,766.39	-	-	-179,156,484.37	193,532,250.76
买入返售金融资产	33,502,526.96	-	-	-	33,502,526.96
应收股利	-	-	-	161,392.00	161,392.00
应收申购款	-	-	-	29,727.28	29,727.28
资产总计	49,476,753.85	-	-	-179,347,603.65	228,824,357.50
负债					
应付赎回款	-	-	-	66,342.57	66,342.57
应付管理人报酬	-	-	-	236,126.34	236,126.34
应付托管费	-	-	-	39,354.40	39,354.40
应付销售服务费	-	-	-	48,587.24	48,587.24
应交税费	-	-	-	1,204.46	1,204.46
其他负债	-	-	-	294,254.37	294,254.37
负债总计	-	-	-	685,869.38	685,869.38
利率敏感度缺口	49,476,753.85	-	-	-178,661,734.27	228,138,488.12
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	896,621.72	-	-	-	896,621.72
结算备付金	4.49	-	-	-	4.49
交易性金融资产	18,345,378.08	1,960,128.88	-	-234,235,444.02	254,540,950.98
买入返售金融资产	40,094,028.64	-	-	-	40,094,028.64
应收申购款	-	-	-	2,613,381.80	2,613,381.80
资产总计	59,336,032.93	1,960,128.88	-	-236,848,825.82	298,144,987.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	147,622.91	147,622.91
应付管理人报酬	-	-	-	307,016.63	307,016.63
应付托管费	-	-	-	51,169.42	51,169.42
应付销售服务费	-	-	-	71,533.92	71,533.92
应交税费	-	-	-	3,487.67	3,487.67

其他负债	-	-	-	85,000.00	85,000.00
负债总计	-	-	-	665,830.55	665,830.55
利率敏感度缺口	59,336,032.93	1,960,128.88	-	-236,182,995.27	297,479,157.08

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

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； 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	8,075.61	19,058.67
	市场利率上升 25 个基点	-8,045.60	-19,017.27

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。本基金持有非人民币计价的资产，存在相应外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	20,766,883.42	-	20,766,883.42
应收股利	-	161,392.00	-	161,392.00
资产合计	-	20,928,275.42	-	20,928,275.42
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-

资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	20,928,275.42	-	20,928,275.42
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资 产	-	27,682,193.60	-	27,682,193.60
资产合计	-	27,682,193.60	-	27,682,193.60
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	27,682,193.60	-	27,682,193.60

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外的市场因素保持不变		
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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币升 值 5%	1,038,344.17	1,384,109.68
	港币相对人民币贬 值 5%	-1,038,344.17	-1,384,109.68

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，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：股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中，港股通标的股票最高投资比例不得超过股票资产的 50%；每个交易日日终，在扣除国债期货合约和股指期货合约需

缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	179,156,484.37	78.53	234,235,444.02	78.74
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	14,375,766.39	6.30	20,305,506.96	6.83
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	193,532,250.76	84.83	254,540,950.98	85.57

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准之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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	12,611,102.53	9,396,965.93
	业绩比较基准下降5%	-12,611,102.53	-9,396,965.93

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	178,805,412.01	234,047,543.60
第二层次	14,417,983.20	20,305,506.96
第三层次	308,855.55	187,900.42
合计	193,532,250.76	254,540,950.98

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可转换债券等，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，本基金分别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不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2024 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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

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	179,156,484.37	78.29
	其中：股票	179,156,484.37	78.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,375,766.39	6.28
	其中：债券	14,375,766.39	6.28
	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	33,502,526.96	14.64
	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	1,598,460.50	0.70
8	其他各项资产	191,119.28	0.08
9	合计	228,824,357.50	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 20,766,883.42 元，占期末基金资产净值比例为 9.10%。

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

金额单位：人民币元

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	11,100,500.00	4.87
C	制造业	139,598,292.26	61.19
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	7,322,900.00	3.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,036.04	0.02

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	332,872.65	0.15
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	158,389,600.95	69.43

7.2.2 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（%）
日常消费品	10,465,245.22	4.59
医疗保健	10,267,650.00	4.50
通讯业务	33,988.20	0.01
合计	20,766,883.42	9.10

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	600572	康恩贝	2,400,000	10,728,000.00	4.70
2	H02273	固生堂	300,000	10,267,650.00	4.50
3	601100	恒立液压	220,000	10,247,600.00	4.49
4	300298	三诺生物	400,000	10,136,000.00	4.44
5	002705	新宝股份	700,000	9,849,000.00	4.32
6	600600	青岛啤酒	130,000	9,460,100.00	4.15
7	600176	中国巨石	850,000	9,392,500.00	4.12
8	688008	澜起科技	150,000	8,574,000.00	3.76
9	300450	先导智能	480,000	7,982,400.00	3.50
10	603600	永艺股份	750,000	7,830,000.00	3.43
11	000625	长安汽车	550,013	7,386,674.59	3.24
12	601021	春秋航空	130,000	7,322,900.00	3.21
13	601899	紫金矿业	400,000	7,028,000.00	3.08
14	605377	华旺科技	500,000	6,625,000.00	2.90
15	300316	晶盛机电	200,000	5,746,000.00	2.52
16	300856	科思股份	160,000	5,121,600.00	2.24
17	600150	中国船舶	120,000	4,885,200.00	2.14
18	002233	塔牌集团	650,000	4,751,500.00	2.08
19	688696	极米科技	60,000	4,634,400.00	2.03

20	H02367	巨子生物	110,000	4,603,101.58	2.02
21	601137	博威合金	300,000	4,572,000.00	2.00
22	300396	迪瑞医疗	220,000	4,468,200.00	1.96
23	000725	京东方 A	1,000,000	4,090,000.00	1.79
24	000975	银泰黄金	250,000	4,072,500.00	1.79
25	H00291	华润啤酒	160,000	3,833,256.00	1.68
26	601233	桐昆股份	150,000	2,394,000.00	1.05
27	H09633	农夫山泉	60,000	2,028,887.64	0.89
28	002475	立讯精密	10,000	393,100.00	0.17
29	000888	峨眉山 A	30,000	326,700.00	0.14
30	301589	诺瓦星云	569	107,159.77	0.05
31	H00700	腾讯控股	100	33,988.20	0.01
32	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
33	002916	深南电路	200	21,154.00	0.01
34	603285	键邦股份	1,105	20,608.25	0.01
35	688692	达梦数据	81	16,972.74	0.01
36	301536	星辰科技	428	13,807.28	0.01
37	301538	骏鼎达	149	13,591.78	0.01
38	301392	汇成真空	219	12,235.53	0.01
39	688691	灿芯股份	247	12,196.86	0.01
40	301565	中仑新材	510	11,893.20	0.01
41	301580	爱迪特	141	10,434.00	0.00
42	301566	达利凯普	576	9,648.00	0.00
43	301539	宏鑫科技	361	8,772.30	0.00
44	688709	成都华微	464	8,709.28	0.00
45	001389	广合科技	205	8,616.15	0.00
46	301591	肯特股份	219	8,085.48	0.00
47	301587	中瑞股份	288	7,804.80	0.00
48	688530	欧莱新材	344	6,522.24	0.00
49	601033	永兴股份	387	6,172.65	0.00
50	688695	中创股份	186	5,866.44	0.00
51	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
52	301502	华阳智能	138	5,217.78	0.00
53	603341	龙旗科技	120	4,496.40	0.00
54	001359	平安电工	168	3,462.48	0.00
55	603082	北自科技	107	3,154.36	0.00
56	603375	盛景微	72	2,799.36	0.00
57	603325	博隆技术	41	2,788.82	0.00
58	603344	星德胜	122	2,764.52	0.00
59	001387	雪祺电气	173	2,634.79	0.00
60	001379	腾达科技	195	2,628.60	0.00
61	603381	永臻股份	95	2,526.05	0.00
62	603312	西典新能	96	2,432.64	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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601899	紫金矿业	15,477,294.00	5.20
2	600600	青岛啤酒	12,474,479.00	4.19
3	300450	先导智能	11,006,162.00	3.70
4	601100	恒立液压	10,252,276.00	3.45
5	601233	桐昆股份	9,704,083.00	3.26
6	600176	中国巨石	9,574,222.00	3.22
7	603600	永艺股份	9,311,017.00	3.13
8	601021	春秋航空	8,401,052.00	2.82
9	000625	长安汽车	7,802,455.21	2.62
10	603501	韦尔股份	6,987,537.60	2.35
11	688008	澜起科技	6,161,409.85	2.07
12	688696	极米科技	5,900,186.93	1.98
13	600547	山东黄金	5,860,094.00	1.97
14	000725	京东方 A	5,606,050.00	1.88
15	002714	牧原股份	5,505,555.83	1.85
16	H00291	华润啤酒	5,447,411.21	1.83
17	300396	迪瑞医疗	5,221,412.86	1.76
18	H01548	金斯瑞生物科技	4,934,705.78	1.66
19	002233	塔牌集团	4,918,736.00	1.65
20	H02367	巨子生物	4,692,839.35	1.58

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002916	深南电路	17,646,826.40	5.93
2	601233	桐昆股份	17,635,768.00	5.93
3	002475	立讯精密	15,578,597.00	5.24
4	688169	石头科技	14,489,745.34	4.87
5	601137	博威合金	11,794,314.00	3.96
6	601899	紫金矿业	10,224,112.00	3.44
7	H00700	腾讯控股	9,488,716.08	3.19
8	603187	海容冷链	8,862,034.49	2.98
9	601111	中国国航	8,782,000.00	2.95
10	300856	科思股份	8,340,885.00	2.80
11	301035	润丰股份	7,952,284.00	2.67

12	600026	中远海能	7,900,107.00	2.66
13	600885	宏发股份	7,370,525.00	2.48
14	603501	韦尔股份	7,301,113.50	2.45
15	H02689	玖龙纸业	6,534,309.20	2.20
16	000975	银泰黄金	6,529,186.00	2.19
17	300298	三诺生物	6,323,341.00	2.13
18	002705	新宝股份	6,206,391.00	2.09
19	002714	牧原股份	6,108,842.97	2.05
20	600547	山东黄金	5,432,845.00	1.83

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	202,176,907.93
卖出股票收入（成交）总额	244,346,166.28

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	4,031,700.82	1.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,344,065.57	4.53
	其中：政策性金融债	10,344,065.57	4.53
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	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,375,766.39	6.30

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	190208	19 国开 08	100,000	10,344,065.57	4.53
2	019631	20 国债 05	40,000	4,031,700.82	1.77

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度参与股指期货投资。基金管理人充分考虑选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，并考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，降低投资组合的整体风险。

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证券趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性水平等指标进行跟踪监控。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内没有投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

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	161,392.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	29,727.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	191,119.28

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)	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 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
路博迈中 国机遇混 合 A	2,813	53,843.73	79,086.78	0.0522	151,383,323.30	99.9478
路博迈中 国机遇混 合 C	4,086	25,455.54	1,130,093.63	1.0865	102,881,243.81	98.9135
合计	6,816	37,481.48	1,209,180.41	0.4733	254,264,567.11	99.5267

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	路博迈中国机遇混合 A	2,475,288.98	1.6343
	路博迈中国机遇混合 C	776,081.78	0.7462
	合计	3,251,370.76	1.2727

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	路博迈中国机遇混合 A	>100
	路博迈中国机遇混合 C	50~100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	路博迈中国机遇混合 A	>100
	路博迈中国机遇混合 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	路博迈中国机遇混合 A	路博迈中国机遇混合 C
基金合同生效日（2023 年 06 月 16 日）基金份额总额	191,051,242.54	241,725,134.28
本报告期初基金份额总额	172,950,651.56	147,426,857.27
本报告期基金总申购份额	23,001,795.35	43,603,999.87
减：本报告期基金总赎回份额	44,490,036.83	87,019,519.70
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	151,462,410.08	104,011,337.44

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

截止本报告期末，基金管理人未发生重大人事变动。本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期内基金投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其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 (%)	
东北证券	3	-	-	-	-	-
华泰证券	3	445,271,983.05	100.00	366,487.19	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：

各相关部门按照合规情况、研究能力、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	
	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(%)
东北证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	6,307,000.37	100.00	3,120,601,000.00	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	路博迈中国机遇混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024-1-22
2	路博迈基金管理（中国）有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-1-22
3	路博迈基金管理（中国）有限公司关于旗下基金新增珠海盈米基金销售有限公司并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024-1-29
4	关于旗下部分基金新增上海陆享基金销售有限公司并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024-3-7
5	关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024-3-13
6	关于旗下基金新增上海中正达广基金销售有限公司并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024-3-27
7	路博迈中国机遇混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024-3-30
8	路博迈基金管理（中国）有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-3-30
9	路博迈基金管理（中国）有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-4-22

10	路博迈中国机遇混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024-4-22
11	关于旗下基金新增北京创金启富基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024-5-6
12	关于旗下基金新增京东肯特瑞基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024-5-29
13	关于旗下基金新增东方财富证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024-6-20
14	路博迈中国机遇混合型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-6-26
15	路博迈中国机遇混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-6-26

§ 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

2024 年 08 月 31 日