# 路博迈中国绿色债券债券型证券投资基金
# 2025 年中期报告

2025 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 30 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 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 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 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 ..... 6

**§4 管理人报告 ..... 7**

4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 9
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 ..... 9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 11
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 ..... 11

**§5 托管人报告 ..... 11**

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 11
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 ..... 11
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 ..... 11

**§6 半年度财务会计报告（未经审计） ..... 12**

6.1 资产负债表 ..... 12
6.2 利润表 ..... 13
6.3 净资产变动表 ..... 14
6.4 报表附注 ..... 16

**§7 投资组合报告 ..... 32**

7.1 期末基金资产组合情况 ..... 32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 ..... 33
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 ..... 33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 33
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 ..... 34
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 ..... 34
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 ..... 34

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 ..... 34
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 34
7.11 投资组合报告附注 ..... 34

**§8 基金份额持有人信息 ..... 35**

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 35
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 35
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 ..... 35

**§9 开放式基金份额变动 ..... 36**

**§10 重大事件揭示 ..... 36**

10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 36
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 ..... 36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 36
10.4 基金投资策略的改变 ..... 36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 36
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 ..... 36
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 ..... 37
10.8 其他重大事件 ..... 38

**§11 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 39**

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 ..... 39
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 39

**§12 备查文件目录 ..... 39**

12.1 备查文件目录 ..... 39
12.2 存放地点 ..... 40
12.3 查阅方式 ..... 40

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 路博迈中国绿色债券债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 路博迈中国绿色债券 |
| 基金主代码 | 019520 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 9 月 26 日 |
| 基金管理人 | 路博迈基金管理（中国）有限公司 |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,184,881,833.18 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金以中国绿色债券为主要投资对象，以绿色投资为投资原则，在控制信用风险、谨慎投资的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将通过对宏观经济运行情况、国家货币及财政政策、资本市场资金环境、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产的预期收益进行动态跟踪，利用公司研究开发的多因子模型等数量工具，优化基金资产在信用债、利率债以及货币市场工具等各类固定收益类金融工具之间的配置比例。本基金具体的投资策略包括固定收益类资产投资策略、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-投资优选绿色债券财富（总值）指数收益率 |
| 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理论上高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。 |

## 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 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 林海中 | 冯萌 |
| | 联系电话 | 4008755888 | 021-52629999-213310 |
| | 电子邮箱 | cs@nbchina.com | fengmeng@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008755888 | 95561 |
| 传真 | | 021-32063700 | 021-62159217 |
| 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 | 福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 |
| 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 | 上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼 |
| 邮政编码 | | 200041 | 200120 |
| 法定代表人 | | 阎小庆 | 吕家进 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报 |
| 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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 14,186,324.94 |
| 本期利润 | 9,249,104.18 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0099 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.93% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.83% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 80,345,239.37 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0678 |
| 期末基金资产净值 | 1,272,196,381.35 |
| 期末基金份额净值 | 1.0737 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 7.37% |

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）。

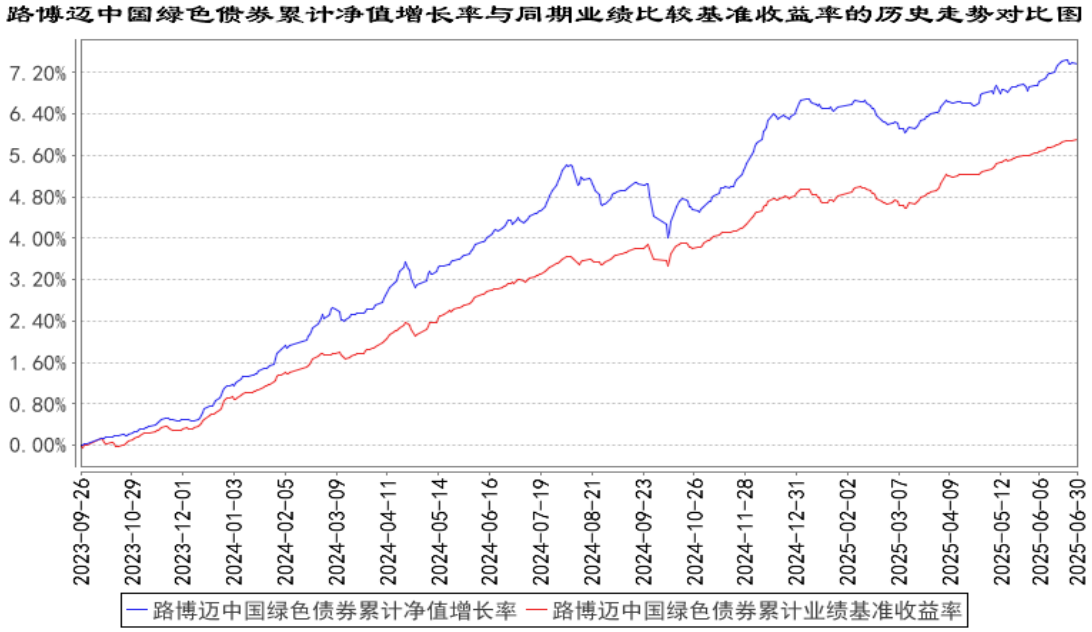
## 3.2 基金净值表现

### 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

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

| | 率① | 准差② | 率③ | ④ | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.41% | 0.03% | 0.28% | 0.01% | 0.13% | 0.02% |
| 过去三个月 | 0.89% | 0.05% | 0.93% | 0.02% | -0.04% | 0.03% |
| 过去六个月 | 0.83% | 0.04% | 1.00% | 0.03% | -0.17% | 0.01% |
| 过去一年 | 2.89% | 0.06% | 2.69% | 0.03% | 0.20% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.37% | 0.06% | 5.90% | 0.03% | 1.47% | 0.03% |

### 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




# §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 12 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、路博迈中高等级信用债债券型证券投资基金、路博迈资源精选股票型发起式证券投资基金、路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金、路博迈 CFETSO-5 年期气候变化

高等级债券综合指数证券投资基金、路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金和路博迈兴航 60 天滚动持有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 | | |
| 魏丽 | 本基金现任基金经理 | 2023 年 9 月 26 日 | - | 15 年 | 魏丽，中国国籍，复旦大学统计学硕士学位。于 2022 年 8 月加入路博迈基金管理（中国）有限公司。现任路博迈基金管理（中国）有限公司公募固收投资部总经理、基金经理，曾任融通基金交易员、研究员；农银汇理基金研究员、基金经理助理、基金经理；光大保德信基金基金经理；汇添富基金投资经理。 |
| 王寒 | 本基金现任基金经理助理 | 2023 年 11 月 8 日 | - | 8 年 | 王寒，中国国籍，复旦大学金融硕士。于 2022 年 3 月加入路博迈基金管理（中国）有限公司，历任研究部信用主管、私募资管投资部投资经理等岗位，现任公募固定收益投资部基金经理、基金经理助理职务。曾任中银基金管理有限公司研究部信用研究员。 |
| 杨名 | 本基金现任基金经理助理 | 2024 年 11 月 12 日 | - | 4 年 | 杨名，中国国籍，凯斯西储大学金融学硕士。于 2024 年 4 月加入路博迈基金管理（中国）有限公司，现任信用研究员兼基金经理助理。曾任上海海通证券资产管理有限公司任固收研究员。 |

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遵规守信情况的说明

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和流程，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中的公平交易模块，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

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

在财政融资和支出节奏前移以及出口维持较强韧性的支撑下，2025 年上半年国内基本面表现较为强劲，实际经济增速录得 5.3%，但受价格压力拖累，名义经济增速仅录得 4.25%。具体来看，供给端表现较为平稳，工业增加值和服务业生产指数增速稳定在 6.0%附近，生产法视角下的实际经济增速稳定在 5.0%的增速目标之上。需求端则呈现出一定的回落压力，固定资产投资和出口增速均有所走弱，社会消费品零售在消费品“以旧换新”政策支撑下表现较为强劲。价格端压力更为明显，CPI 和 PPI 同比增速均处于负增区间，PPI 同比增速受贸易摩擦等因素影响跌幅明显走阔，GDP 平减指数二季度滑落至-1.2%。融资端景气度显著分化，以私人部门融资为主的信贷增速持续下行，社会融资增速则在政府融资扩张的支撑下小幅修复，表明私人部门预期仍未企稳。总体来看，国内基本面依然延续着生产强、需求弱的格局，物价广泛承压，融资需求低迷，贸易摩擦对基本面的影响尚未充分显现。

在此背景下，上半年债券收益率曲线总体呈现震荡格局，利率曲线长、短端表现分化，1 年期与 10 年期期限利差压缩约 30 个基点，信用利差压缩约 5 至 30 个基点。具体来看，一季度债券市

场总体呈现震荡调整态势，利率曲线短端上移约 30 个基点，长端上移约 15 个基点，曲线呈现熊平态势；信用利差则呈现被动压缩态势，短端普信债信用利差压缩 15 个基点左右，长端压缩幅度约为 10 个基点。一方面，经济基本面连续两个季度呈现企稳态势，市场前期较为悲观的经济预期有所修复，部分领域取得的技术突破也明显提振了市场风险偏好，收益率曲线承压调整。另一方面，在内外部压力下，央行春节假期后对资金面的态度偏紧，多次表态矫正市场较为激进的货币宽松预期，叠加同业负债转移导致银行体系流动性偏紧，资金利率预期维持在偏高水平，负息差带来了进一步的调整压力。二季度债券收益率曲线则呈现修复式下移，利率曲线向下平移约 15 个基点，信用利差压缩约 5 至 15 个基点。一方面，国际贸易形势相较一季度总体恶化，国内基本面虽仅温和降温但预期走弱，物价走势和私人部门融资需求低迷，宽货币预期明显升温。另一方面，美元指数持续下行，离岸人民币汇率与中间价价差逐渐收敛，中国央行面临的外部均衡压力减弱，政策空间打开后于 5 月份相继降息、降准，并引导存款利率进一步下调，银行体系负债端压力减弱，银行间市场资金价格预期较一季度明显回落，牵引利率曲线下移。

报告期内，本基金一季度从久期策略切换至票息策略，控制回撤，平滑波动；二季度逐步拉长久期，增加杠杆，兼具票息与久期策略。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值 1.0737 元，本报告期内净值增长率 0.83%，同期业绩比较基准收益率 1.00%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望来看，下半年实际经济增速环比下行压力增强，但通缩压力有望阶段性收敛。一是，今年财政融资和支出节奏明显前移，意味着按照年初预算约束下的财政支出力度应会走弱，同时，贸易摩擦对海外需求和国内出口的影响将会逐步显现，内外部因素均指向经济增速存在放缓压力；二是，上半年实际经济增速表现较好，减弱了全年经济增速目标达成的难度，这意味着若非遭遇预期外冲击，财政政策进一步加码的可能性较为有限；三是，在基数走低和“反内卷”等政策支撑下，下半年 GDP 平减指数跌幅有望先走稳后收敛，但弹性或较为有限，关注 7 月政治局会议前后是否会进一步加强针对“反内卷”的政策部署；四是，上半年在财政融资节奏前移支撑下，社会融资增速从 8.0%修复至 8.9%，但若下半年未有财政增量额度，则意味着政府部门净融资将会从驱动因素转为拖累因素，社会融资增速可能会回落。供需面，上半年政府债券融资节奏较快，净融资规模同比多增 4.35 万亿元，下半年政府债券融资节奏有望放缓，净融资规模应会同比收缩 1.78 万亿元，若机构配置需求保持稳定，则供需相对态势将会明显改善。债券市场下半年有望获得比上半年更多的支撑。

### 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

# §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：路博迈中国绿色债券债券型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 1,956,241.02 | 5,891,174.75 |
| 结算备付金 | | 12,397.85 | 10,371.48 |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,374,968,238.81 | 1,028,007,794.95 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,374,968,238.81 | 1,026,070,389.79 |
| 资产支持证券投资 | | - | 1,937,405.16 |
| 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 | 11,021,056.71 | 47,003,806.00 |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 100,049,059.98 | 1,829,634.07 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 1,488,006,994.37 | 1,082,742,781.25 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2025 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>2024 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 | | 215,075,816.87 | 208,106,387.23 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 103,026.31 | 1,060.96 |
| 应付管理人报酬 | | 260,754.81 | 218,625.84 |
| 应付托管费 | | 86,918.27 | 72,875.28 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 54,928.10 | 46,713.26 |
| 应付利润 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 229,168.66 | 182,461.27 |
| 负债合计 | | 215,810,613.02 | 208,628,123.84 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 1,184,881,833.18 | 820,858,435.32 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 87,314,548.17 | 53,256,222.09 |
| 净资产合计 | | 1,272,196,381.35 | 874,114,657.41 |
| 负债和净资产总计 | | 1,488,006,994.37 | 1,082,742,781.25 |

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0737 元，基金份额总额 1,184,881,833.18 份。

## 6.2 利润表

会计主体：路博迈中国绿色债券债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | 12,403,536.95 | 36,948,672.10 |
| 1.利息收入 | | 122,459.91 | 264,622.21 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 5,624.76 | 241,327.41 |
| 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 | | 116,835.15 | 23,294.80 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 17,218,264.80 | 24,903,035.21 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 17,213,211.60 | 24,847,027.32 |
| 资产支持证券投资收益 | | 5,053.20 | 56,007.89 |
| 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 | - | - |
| 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 | -4,937,220.76 | 11,781,014.68 |
| 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 | 33.00 | - |
| **减：二、营业总支出** | | 3,154,432.77 | 4,858,295.07 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,475,190.67 | 1,539,887.56 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2．托管费 | 6.4.10.2.2 | 491,730.17 | 513,295.87 |
| 3．销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4．投资顾问费 | | - | - |
| 5．利息支出 | | 1,042,305.76 | 2,652,122.90 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,042,305.76 | 2,652,122.90 |
| 6．信用减值损失 | 6.4.7.17 | - | - |
| 7．税金及附加 | | 35,473.53 | 48,351.51 |
| 8．其他费用 | 6.4.7.18 | 109,732.64 | 104,637.23 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 9,249,104.18 | 32,090,377.03 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 9,249,104.18 | 32,090,377.03 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - | - |
| **六、综合收益总额** | | 9,249,104.18 | 32,090,377.03 |

## 6.3 净资产变动表

会计主体：路博迈中国绿色债券债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 820,858,435.32 | 53,256,222.09 | 874,114,657.41 |
| 二、本期期初净资产 | 820,858,435.32 | 53,256,222.09 | 874,114,657.41 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 364,023,397.86 | 34,058,326.08 | 398,081,723.94 |
| （一）、综合收益总额 | - | 9,249,104.18 | 9,249,104.18 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| （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） | 364,023,397.86 | 24,809,221.90 | 388,832,619.76 |
| 其中：1.基金申购款 | 504,429,593.15 | 33,958,027.57 | 538,387,620.72 |
| 2.基金赎回款 | -140,406,195.29 | -9,148,805.67 | -149,555,000.96 |
| （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、本期期末净资产 | 1,184,881,833.18 | 87,314,548.17 | 1,272,196,381.35 |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 1,000,307,593.50 | 11,579,963.72 | 1,011,887,557.22 |
| 二、本期期初净资产 | 1,000,307,593.50 | 11,579,963.72 | 1,011,887,557.22 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 17,275,702.89 | 32,676,801.35 | 49,952,504.24 |
| （一）、综合收益总额 | - | 32,090,377.03 | 32,090,377.03 |
| （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） | 17,275,702.89 | 586,424.32 | 17,862,127.21 |
| 其中：1.基金申购款 | 17,403,520.44 | 589,975.27 | 17,993,495.71 |
| 2.基金赎回款 | -127,817.55 | -3,550.95 | -131,368.50 |
| （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、本期期末净资产 | 1,017,583,296.39 | 44,256,765.07 | 1,061,840,061.46 |

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

路博迈中国绿色债券债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2023 年 9 月 11 日证监许可【2023】2114 号《关于准予路博迈中国绿色债券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《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《路博迈中国绿色债券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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。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 9 月 26 日正式生效，生效日的基金份额总额为 2,194,183,882.72 份，经毕马威华振会计师事务所 （特殊普通合伙） 验字第 2300625 号验资报告予以验证。

本基金的投资范围包括国内依法发行的金融工具，包括债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分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、银行存款、同业存单、现金、国债期货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的相关规定)。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。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：中债-投资优选绿色债券财富（总值）指数收益率。

### 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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

### 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 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况、自 2025 年 1 月 1 日至 2025 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》、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》、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。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。

b)对证券投资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。

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。

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。

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。

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<br>2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 1,956,098.21 |
| 等于：本金 | 1,956,036.90 |
| 加：应计利息 | 61.31 |
| 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 | 142.81 |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | 142.81 |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 1,956,241.02 |

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 2025 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | - | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 50,948,899.17 | 483,081.64 | 51,202,081.64 | -229,899.17 |
| | 银行间市场 | 1,303,746,119.93 | 12,232,157.17 | 1,323,766,157.17 | 7,787,880.07 |
| | 合计 | 1,354,695,019.10 | 12,715,238.81 | 1,374,968,238.81 | 7,557,980.90 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 1,354,695,019.10 | 12,715,238.81 | 1,374,968,238.81 | 7,557,980.90 |

## 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 2025 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 11,021,056.71 | - |
| 合计 | 11,021,056.71 | - |

### 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<br>2025 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 | 24,866.10 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 24,866.10 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用-审计费 | 24,795.19 |
| 预提费用-信息披露费 | 179,507.37 |
| 合计 | 229,168.66 |

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 820,858,435.32 | 820,858,435.32 |
| 本期申购 | 504,429,593.15 | 504,429,593.15 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -140,406,195.29 | -140,406,195.29 |
| 本期末 | 1,184,881,833.18 | 1,184,881,833.18 |

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

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 42,968,517.20 | 10,287,704.89 | 53,256,222.09 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 42,968,517.20 | 10,287,704.89 | 53,256,222.09 |
| 本期利润 | 14,186,324.94 | -4,937,220.76 | 9,249,104.18 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 23,190,397.23 | 1,618,824.67 | 24,809,221.90 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 其中：基金申购款 | 31,792,600.62 | 2,165,426.95 | 33,958,027.57 |
| 基金赎回款 | -8,602,203.39 | -546,602.28 | -9,148,805.67 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 80,345,239.37 | 6,969,308.80 | 87,314,548.17 |

### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 1,789.68 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 613.76 |
| 结算备付金利息收入 | 2,026.37 |
| 其他 | 1,194.95 |
| 合计 | 5,624.76 |

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

本基金本报告期内无股票投资收益。

### 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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|---|---|
| 债券投资收益——利息收入 | 13,717,282.41 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 3,495,929.19 |
| 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 | 17,213,211.60 |

### 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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|---|---|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 947,179,183.16 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 933,276,579.79 |

| | |
|---|---|
| 减：应计利息总额 | 10,380,158.39 |
| 减：交易费用 | 26,515.79 |
| 买卖债券差价收入 | 3,495,929.19 |

### 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

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|---|---|
| 资产支持证券投资收益——利息收入 | 5,053.20 |
| 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入 | - |
| 资产支持证券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 资产支持证券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 5,053.20 |

### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|---|---|
| 卖出资产支持证券成交总额 | 1,939,891.19 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 1,929,000.00 |
| 减：应计利息总额 | 10,891.19 |
| 减：交易费用 | - |
| 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

本基金本报告期内无股利收益。

### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|---|---|

| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | -4,937,220.76 |
| 股票投资 | - |
| 债券投资 | -4,937,220.76 |
| 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 | -4,937,220.76 |

### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | 33.00 |
| 合计 | 33.00 |

### 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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 24,795.19 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 汇划手续费 | 6,830.08 |
| 账户维护费_中债登 | 9,000.00 |
| 账户维护费_上清所 | 9,600.00 |
| 合计 | 109,732.64 |

## 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

### 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 |
| 兴业银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 路博迈投资顾问有限公司 | 基金管理人的股东 |

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| --- | --- | --- |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,475,190.67 | 1,539,887.56 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 435,287.81 | 460,320.29 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 1,039,902.86 | 1,079,567.27 |

注：支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值 0.30%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：

日基金管理费＝前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 491,730.17 | 513,295.87 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比期间无销售服务费。

### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未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

本基金本报告期内及上年度可比期间未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

本基金本报告期内及上年度可比期间未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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

### 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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | | 上年度末<br>2024年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例（%） |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 兴业银行股份有限公司 | 299,999,000.00 | 25.3189 | 299,999,000.00 | 36.5470 |

### 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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024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 |
| 兴业银行股份有限公司 | 1,956,098.21 | 1,789.68 | 326,069.08 | 4,707.66 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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（2025 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

### 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

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金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人民币 215,075,816.87 元，是以如下债券作为质押:

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|
| 092203003 | 22 进出清发绿债 03 | 2025 年 07 月 01 日 | 102.12 | 200,000 | 20,424,684.93 |
| 102484131 | 24 中油股 MTN001(绿色两新) | 2025 年 07 月 01 日 | 103.31 | 264,000 | 27,274,838.14 |
| 102581280 | 25 国新租赁 | 2025 年 07 月 02 日 | 101.12 | 38,000 | 3,842,500.03 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | MTN001(绿色) | | | | |
| 132580004 | 25 南京安居 GN001 | 2025 年 07 月 01 日 | 101.09 | 400,000 | 40,436,054.79 |
| 132580007 | 25 南京地铁 GN001 | 2025 年 07 月 01 日 | 101.01 | 400,000 | 40,404,131.51 |
| 2202003 | 22 国开绿债 03 | 2025 年 07 月 01 日 | 101.70 | 485,000 | 49,322,400.55 |
| 312410009 | 24 中行 TLAC 非资本绿债 01(BC) | 2025 年 07 月 02 日 | 100.90 | 500,000 | 50,452,334.25 |
| 合计 | | | | 2,287,000 | 232,156,944.20 |

### 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

本基金为债券型基金，其预期风险及预期收益水平理论上高于货币市场基金，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、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

本基金于本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| A-1 | - | 1,937,405.16 |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | - | 1,937,405.16 |

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、A-1 评级包括存续期一年以内、AAA 评级的资产支持证券。

4、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及上年度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<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| AAA | 539,585,303.04 | 317,534,603.67 |
| AAA 以下 | 52,112,831.23 | 132,663,639.44 |
| 未评级 | 783,270,104.54 | 575,872,146.68 |
| 合计 | 1,374,968,238.81 | 1,026,070,389.79 |

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、未评级债券为企业债、中期票据、国债及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及上年度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及上年度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货币资金、结算备付金和债券投资等。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，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2025 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 | 1,956,241.02 | - | - | - | 1,956,241.02 |
| 结算备付金 | 12,397.85 | - | - | - | 12,397.85 |
| 交易性金融资产 | 213,651,501.38 | 767,021,726.60 | 394,295,010.83 | - | 1,374,968,238.81 |
| 买入返售金融资产 | 11,021,056.71 | - | - | - | 11,021,056.71 |
| 应收申购款 | - | - | - | 100,049,059.98 | 100,049,059.98 |
| 资产总计 | 226,641,196.96 | 767,021,726.60 | 394,295,010.83 | 100,049,059.98 | 1,488,006,994.37 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 215,075,816.87 | - | - | - | 215,075,816.87 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 103,026.31 | 103,026.31 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 260,754.81 | 260,754.81 |
| 应付托管费 | - | - | - | 86,918.27 | 86,918.27 |
| 应交税费 | - | - | - | 54,928.10 | 54,928.10 |
| 其他负债 | - | - | - | 229,168.66 | 229,168.66 |
| 负债总计 | 215,075,816.87 | - | - | 734,796.15 | 215,810,613.02 |
| 利率敏感度缺口 | 11,565,380.09 | 767,021,726.60 | 394,295,010.83 | 99,314,263.83 | 1,272,196,381.35 |
| 上年度末<br>2024 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 | 5,891,174.75 | - | - | - | 5,891,174.75 |
| 结算备付金 | 10,371.48 | - | - | - | 10,371.48 |
| 交易性金融资产 | 286,255,999.67 | 627,723,911.43 | 114,027,883.85 | - | 1,028,007,794.95 |
| 买入返售金融资产 | 47,003,806.00 | - | - | - | 47,003,806.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,829,634.07 | 1,829,634.07 |
| 资产总计 | 339,161,351.90 | 627,723,911.43 | 114,027,883.85 | 1,829,634.07 | 1,082,742,781.25 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 208,106,387.23 | - | - | - | 208,106,387.23 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,060.96 | 1,060.96 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 218,625.84 | 218,625.84 |
| 应付托管费 | - | - | - | 72,875.28 | 72,875.28 |
| 应交税费 | - | - | - | 46,713.26 | 46,713.26 |
| 其他负债 | - | - | - | 182,461.27 | 182,461.27 |
| 负债总计 | 208,106,387.23 | - | - | 521,736.61 | 208,628,123.84 |
| 利率敏感度缺口 | 131,054,964.67 | 627,723,911.43 | 114,027,883.85 | 1,307,897.46 | 874,114,657.41 |

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；<br>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 | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 动 | 本期末（2025 年 6 月 30 日） | 上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ） |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 14,942,027.16 | 6,909,077.08 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -14,520,174.59 | -6,762,868.88 |

### 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，因此无重大外汇风险。

### 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。本基金主要投资于固定收益类品种，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动，对本基金净资产无重大影响。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金的净值无重大影响，所以未进行其他价格的敏感性分析。

## 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<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|

| | | |
|---|---|---|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 1,374,968,238.81 | 1,028,007,794.95 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 1,374,968,238.81 | 1,028,007,794.95 |

### 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 2025 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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,374,968,238.81 | 92.40 |
| | 其中：债券 | 1,374,968,238.81 | 92.40 |
| | 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 | 11,021,056.71 | 0.74 |
| | 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 | 1,968,638.87 | 0.13 |
| 8 | 其他各项资产 | 100,049,059.98 | 6.72 |
| 9 | 合计 | 1,488,006,994.37 | 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

本基金不投资于股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金不投资于股票。

## 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

本基金不投资于股票。

## 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

本基金不投资于股票。

### 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

本基金不投资于股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金不投资于股票。

## 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 | 124,581,122.06 | 9.79 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 431,676,972.61 | 33.93 |
| | 其中：政策性金融债 | 126,743,589.04 | 9.96 |
| 4 | 企业债券 | 51,202,081.64 | 4.02 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 767,508,062.50 | 60.33 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,374,968,238.81 | 108.08 |

## 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 | 2500001 | 25 超长特别国债 01 | 1,000,000 | 101,722,459.02 | 8.00 |
| 2 | 220215 | 22 国开 15 | 500,000 | 55,471,068.49 | 4.36 |
| 3 | 2202003 | 22 国开绿债 03 | 500,000 | 50,847,835.62 | 4.00 |
| 4 | 2420055 | 24 西安银行绿色债 | 500,000 | 50,801,331.51 | 3.99 |
| 5 | 312410009 | 24 中行 TLAC 非资本绿债 01(BC) | 500,000 | 50,452,334.25 | 3.97 |

## 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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内没有投资国债期货。

### 7.10.2 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。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局北京监管局的处罚，西安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行陕西省分行的处罚，江苏金融租赁股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局江苏监管局的处罚。本基金投资的前十名证券中，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

### 7.11.2 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

本基金不投资于股票。

### 7.11.3 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 | 100,049,059.98 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 100,049,059.98 |

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金不投资于股票。

### 7.11.6 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，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

| 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（%） |
| 617 | 1,920,391.95 | 1,182,316,429.32 | 99.7835 | 2,565,403.86 | 0.2165 |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 138,519.13 | 0.0117 |

### 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 | 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 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

# §9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2023 年 09 月 26 日）基金份额总额 | 2,194,183,882.72 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 820,858,435.32 |
| 本报告期基金总申购份额 | 504,429,593.15 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 140,406,195.29 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,184,881,833.18 |

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，基金管理人未发生重大人事变动，发生如下高管分工调整：

1、2025 年 3 月 26 日，副总经理许亦先先生不再分管公司机构业务部，机构业务部由总经理阎小庆负责分管。

报告期内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

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中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(%) | |
| 招商证券 | 2 | - | - | 9,140.79 | 100.00 | - |

注：1、交易单元的选择标准：

(1)公司实力雄厚，信誉良好；

(2)公司研究实力较强，研究机构和专门的研究人员能及为基金提供高质量的资讯服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等,并能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告；

(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，可以为公司开展交易提供必要的交易终端，若交易终端无法满足基金产品正常交易需求的，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、交易单元的选择流程：

各相关部门按照研究能力、运营能力、交易服务和合规情况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(%) |
| 招商证 | 91,408,021 | 100.00 | 189,455,000. | 100.00 | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 券 | .51 | | 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 | 关于旗下基金新增浙江同花顺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 | 2025-1-13 |
| 2 | 关于旗下基金新增方正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 | 2025-1-20 |
| 3 | 路博迈中国绿色债券债券型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-1-22 |
| 4 | 路博迈基金管理（中国）有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-1-22 |
| 5 | 关于旗下基金新增上海好买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 | 2025-1-24 |
| 6 | 路博迈基金管理（中国）有限公司关于调整路博迈中国绿色债券债券型证券投资基金最低申购金额限制的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-2-19 |
| 7 | 路博迈中国绿色债券债券型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-3-3 |
| 8 | 关于路博迈中国绿色债券债券型证券投资基金恢复个人投资者申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-3-25 |
| 9 | 路博迈中国绿色债券债券型证券投资基金 2024 年年度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-3-29 |
| 10 | 路博迈基金管理（中国）有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-3-29 |
| 11 | 路博迈基金管理（中国）有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况 | 中国证监会规定媒介 | 2025-3-31 |
| 12 | 路博迈基金管理（中国）有限公司关于旗下产品的服务机构更名事宜的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-4-8 |
| 13 | 路博迈中国绿色债券债券型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2025-4-22 |
| 14 | 路博迈基金管理（中国）有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示 | 中国证监会规定媒介 | 2025-4-22 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 性公告 | | |
| 15 | 关于旗下基金新增奕丰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 | 2025-5-16 |
| 16 | 关于旗下基金新增玄元保险代理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 | 2025-5-23 |

# §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

| 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 | 20250101-20250630 | 470,410,198.51 | - | - | 470,410,198.51 | 39.70 |
| | 2 | 20250101-20250630 | 299,999,000.00 | - | - | 299,999,000.00 | 25.32 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。 | | | | | | | |

注：份额占比精度处理方式为四舍五入。

## 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**

**2025 年 8 月 30 日**