

路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资 基金 2026 年中期报告

2026 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	34
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	35
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	35
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	35

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	35
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	35
7.11 投资组合报告附注	36
§ 8 基金份额持有人信息	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	37
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	37
§ 9 开放式基金份额变动	38
§ 10 重大事件揭示	38
10.1 基金份额持有人大会决议	38
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	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	38
10.4 基金投资策略的改变	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	39
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	39
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	39
10.8 其他重大事件	40
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	41
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	41
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	41
§ 12 备查文件目录	42
12.1 备查文件目录	42
12.2 存放地点	42
12.3 查阅方式	42

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金	
基金简称	路博迈悦航 30 天持有债券	
基金主代码	022615	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 12 月 19 日	
基金管理人	路博迈基金管理（中国）有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	67,930,135.95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	路博迈悦航 30 天持有债券 A	路博迈悦航 30 天持有债券 C
下属分级基金的交 易代码	022615	022616
报告期末下属分级 基金的份额总额	17,855,148.73 份	50,074,987.22 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险并保持资产流动性的前提下，以获取绝对收益为核心投资目标，通过积极主动的投资管理，努力追求组合资产长期稳健的增值。
投资策略	基金管理人将运用多种策略进行资产配置的思路来构建投资组合，根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估预期未来市场利率水平以及利率曲线形态确定债券组合的久期配置，在确定组合久期基础上进行组合期限配置形态的调整。通过对宏观经济、产业行业的研究以及相应的财务分析和非财务分析，“自上而下”在各固定收益类资产之间进行配置、“自下而上”进行个券选择。本基金具体的投资策略包括类属配置策略、债券投资策略、流动性管理策略以及衍生产品投资策略等。
业绩比较基准	中债-新综合全价(总值)指数收益率*80%+银行活期存款利率(税后)*20%
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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘铮	许俊
	联系电话	4008755888	010-66596688
	电子邮箱	cs@nbchina.com	fxjd_hq@bank-of-china.com

客户服务电话	4008755888	95566
传真	021-32063700	010-66594942
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号 30 层 11 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	上海市静安区石门一路 288 号香港兴业中心二座 7 楼 705-710 室	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200041	100818
法定代表人	阎小庆	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.nbchina.com
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	路博迈悦航 30 天持有债券 A	路博迈悦航 30 天持有债券 C
本期已实现收益	147, 196. 12	403, 358. 87
本期利润	181, 249. 87	464, 899. 44
加权平均基金份 额本期利润	0. 0074	0. 0064
本期加权平均净 值利润率	0. 72%	0. 63%
本期基金份额净 值增长率	0. 72%	0. 62%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	443, 506. 57	1, 083, 428. 75

期末可供分配基金份额利润	0.0248	0.0216
期末基金资产净值	18,313,000.00	51,199,183.18
期末基金份额净值	1.0256	1.0225
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	2.56%	2.25%

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

路博迈悦航 30 天持有债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.46%	0.01%	0.52%	0.03%	-0.06%	-0.02%
过去六个月	0.72%	0.01%	0.76%	0.03%	-0.04%	-0.02%
过去一年	1.20%	0.02%	-0.37%	0.04%	1.57%	-0.02%
自基金合同生效起至今	2.56%	0.02%	-0.16%	0.06%	2.72%	-0.04%

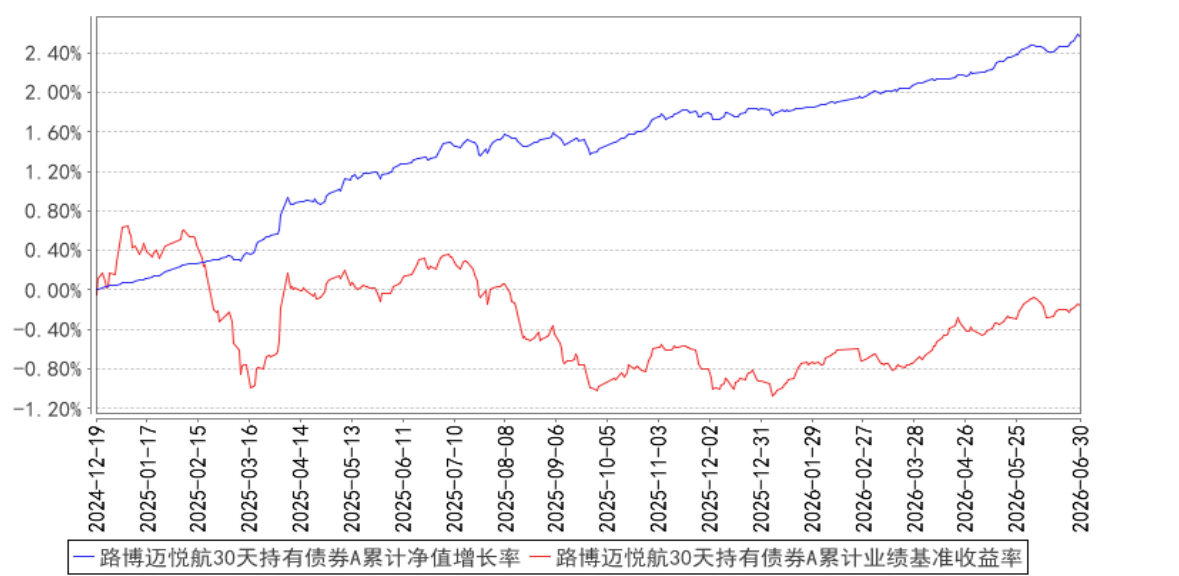
路博迈悦航 30 天持有债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.41%	0.01%	0.52%	0.03%	-0.11%	-0.02%
过去六个月	0.62%	0.01%	0.76%	0.03%	-0.14%	-0.02%
过去一年	1.01%	0.02%	-0.37%	0.04%	1.38%	-0.02%
自基金合同生效	2.25%	0.02%	-0.16%	0.06%	2.41%	-0.04%

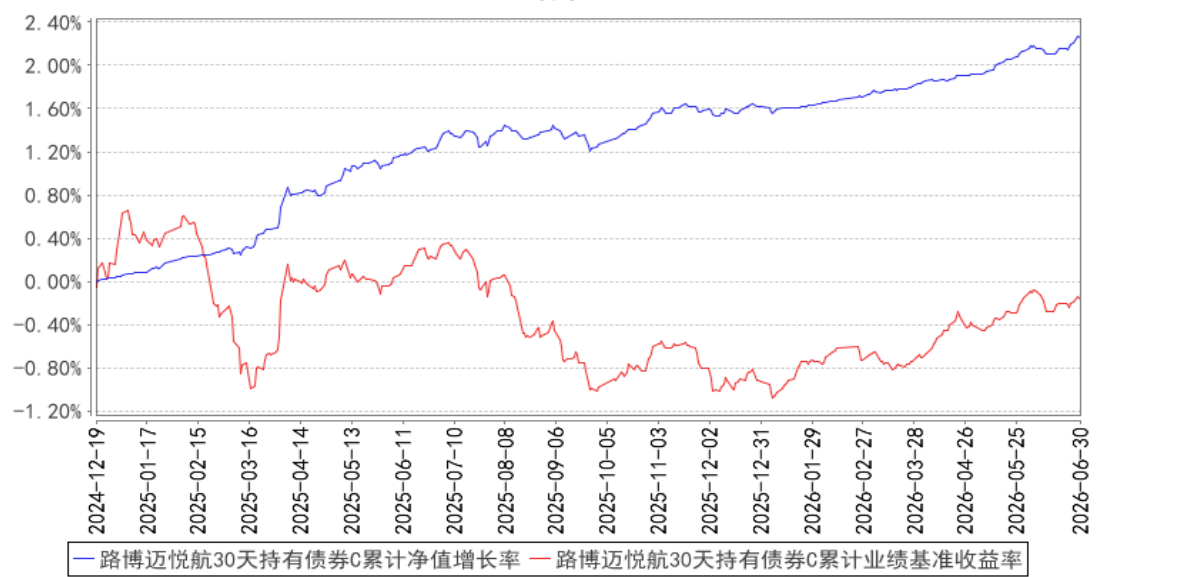
起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

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

路博迈悦航30天持有债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



路博迈悦航30天持有债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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 20 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 CFETS0-5 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、路博迈兴航 60 天滚动持有债券型证券投资基金、路博迈旭航债券型证券投资基金、路博迈上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金、路博迈中债优选投资级信用债指数证券投资基金、路博迈港股通科技股票型证券投资基金、路博迈中证 A 股指数增强型证券投资基金、路博迈添航债券型证券投资基金、路博迈卓越优选混合型证券投资基金、路博迈中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金。

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		
王寒	本基金现任基金经理	2025 年 2 月 28 日	-	10 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，现任公募固收投资部基金经理、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。
王栋	本基金现任基金经理	2025 年 9 月 18 日	-	4 年	王栋，中国国籍，浙江大学会计学硕士。于 2025 年 2 月加入路博迈基金管理（中国）有限公司，现任公募固收投资部联席总经理、基金经理。自 2007 年 7 月至 2025 年 2 月，其先后于中国民生银行深圳分行担任金融同业部业务经理；平安银行股份有限公司担任固定收益部投资经理；平安理财有限责任公司担任固定收益部投资经理；达诚基金管理有限公司担任固定收益部部门总监、基金经理。
魏丽	本基金前任基金经理	2024 年 12 月 19 日	2026 年 3 月 2 日	16 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。
--	--	--	--	--	--------------------------------

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

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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的规定及《基金合同》的约定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则为基金份额持有人谋求利益，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

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

回顾上半年，债券市场的核心运行特征是需求端和资产供给端的阶段性错位，产生了持续的“资产荒”现象。需求端，资金面从 3 月中旬开始以 DR001 为代表的短端利率走势明显下行，在 5 月末之前持续稳定在 1.3% 之下，并出现多日靠近 1.2% 的情况；此外银行存款高增，金融机构各项存款余额 1 月同比增长 9.9%，增幅较高，6 月末同比仍然有 8.2% 的增幅。而资产供给端，社会存量融资规模同比增速从年初的 8.2% 下滑到 6 月末的 7.4%；社融分项内部，比较核心的人民币贷款月度同比增速从 1 月的 6.1% 下滑到 6 月的 5.2%，存款同比增速与贷款同比增速差比较明显。央行 5 月发布的《2026 年第一季度货币政策执行报告》指出，银行债券投融资行为已经成为影响货币供应和信用创造的重要渠道。债市需求和供给阶段性的错位，构成了上半年固收市场的主要影响因素。

上半年本基金组合保持适当久期，前期重点投资信用债，后期重点增加利率债投资，信用债投资以 1-3 年普通信用债和 3-5 年二级资本债为主，利率债投资以 3 年内的政策性金融债为主，并根据资金利率变化适当采取杠杆策略。上半年信用债利差、政金债与国债的税差，总体呈现压缩态势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值 1.0256 元，本报告期内净值增长率 0.72%，同期业绩比较基准收益率 0.76%；截至本报告期末，本基金 C 类份额净值 1.0225 元，本报告期内净值增长率 0.62%，同期业绩比较基准收益率 0.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年债市走势，主要影响因素包括：

一是经济基本面走势，也即信贷和社融增速能否有所恢复，上半年供需的错位能否有所改善，以及社融和人民币信贷扩张态势，目前来看比较依赖财政政策的发力，需重点关注财政供给节奏是否有明显的边际变化。上半年政府债券发行较往年偏慢，我们统计上半年政府债券净融资发行规模在 6.6 万亿左右，同比去年少发行约 1.4 万亿左右，根据往年进度，三季度尤其是 8、9 月份可能会增加供给，从而对债市产生一定的扰动。

二是关注资金面，上半年 DR001 维持在 1.2% - 1.35% 的低位，总体比较宽松，但进入 6 月后 DR001 明显反弹，跨入 7 月后目前仍在 1.35% - 1.4% 区间窄幅震荡，暂时难以回到 1.3%。如果资金不能回落到 1.35% 以下，叠加目前债市利率较低，那么债市三季度继续下行空间或较为有限，央行在 4 月以后持续回笼部分长期资金是重要影响因素。

三是机构投资者行为和监管动作，进入三季度，市场对基金申赎、保险配置行为等更加关注，部分债市投资者上半年浮盈较多，若三季度扰动因素增多，需要关注 8 月以后是否会出现预防性赎回。监管方面，市场关注部分评级虚高债券的后续调整，以及定制债基整改是否有进一步动作，这可能引发债券资产的抛售和负债端的赎回等。

综上所述我们认为三季度走势比二季度要复杂一些，但目前债市整体仍处于牛市环境中，货币政策总体宽松，新旧经济转型对社会融资规模扩张、消费增长有一定拖累，低利率环境还将持续一段时间。债市即便出现调整，其幅度可能较为有限，出现调整反而是加仓配置的较好时机。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，委托基金服务机构对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金管理人及委托的基金服务机构严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，基金份额净值经基金托管人复核无误后由基金管理人对外披露。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金

份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	4,188,396.42	27,818.40
结算备付金		1,258,278.70	1,653,321.02
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	67,717,142.46	95,817,176.98
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		67,717,142.46	90,434,967.12
资产支持证券投资		-	5,382,209.86
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		100.00	208,460.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		73,163,917.58	97,706,776.40
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		3,500,919.89	16,002,462.24

应付清算款		-	-
应付赎回款		30,239.98	2,354,155.87
应付管理人报酬		15,259.75	16,830.72
应付托管费		3,814.92	4,207.71
应付销售服务费		12,484.78	11,203.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,475.17	2,522.93
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	87,539.91	116,669.72
负债合计		3,651,734.40	18,508,053.04
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	67,930,135.95	77,887,786.22
未分配利润	6.4.7.8	1,582,047.23	1,310,937.14
净资产合计		69,512,183.18	79,198,723.36
负债和净资产总计		73,163,917.58	97,706,776.40

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 67,930,135.95 份，其中 A 类基金份额净值 1.0256 元，基金份额 17,855,148.73 份；C 类基金份额净值 1.0225 元，基金份额 50,074,987.22 份。

6.2 利润表

会计主体：路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,000,690.38	10,821,558.06
1. 利息收入		59,781.55	5,093,859.65
其中：存款利息收入	6.4.7.9	54,125.03	547,630.61
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		5,656.52	4,546,229.04
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		845,314.51	5,230,963.67
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	826,233.41	5,206,255.27

资产支持证券投资收益	6.4.7.12	19,081.10	24,708.40
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	-	-
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	95,594.32	496,734.74
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	-	-
减：二、营业总支出		354,541.07	2,575,127.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	99,291.27	1,001,334.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	24,822.79	250,333.78
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	73,772.39	829,590.73
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		48,930.99	358,384.89
其中：卖出回购金融资产支出		48,930.99	358,384.89
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		1,861.75	40,324.90
8. 其他费用	6.4.7.18	105,861.88	95,158.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		646,149.31	8,246,430.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		646,149.31	8,246,430.77
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		646,149.31	8,246,430.77

6.3 净资产变动表

会计主体：路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 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	77,887,786.22	1,310,937.14	79,198,723.36
二、本期期初净资产	77,887,786.22	1,310,937.14	79,198,723.36

三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-9,957,650.27	271,110.09	-9,686,540.18
(一)、综合收益总额	-	646,149.31	646,149.31
(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)	-9,957,650.27	-375,039.22	-10,332,689.49
其中:1. 基金申购款	260,256,793.17	4,945,040.27	265,201,833.44
2. 基金赎回款	-270,214,443.44	-5,320,079.49	-275,534,522.93
(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	67,930,135.95	1,582,047.23	69,512,183.18
项目	上年度可比期间 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	4,426,706,571.25	2,147,721.99	4,428,854,293.24
二、本期期初净资产	4,426,706,571.25	2,147,721.99	4,428,854,293.24
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-4,142,250,460.40	1,440,858.72	-4,140,809,601.68
(一)、综合收益总额	-	8,246,430.77	8,246,430.77
(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)	-4,142,250,460.40	-6,805,572.05	-4,149,056,032.45
其中:1. 基金申购款	192,364,738.57	2,088,204.95	194,452,943.52
2. 基金赎回款	-4,334,615,198.97	-8,893,777.00	-4,343,508,975.97
(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	284,456,110.85	3,588,580.71	288,044,691.56
-----------	----------------	--------------	----------------

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：

<u>阎小庆</u>	<u>阎小庆</u>	<u>黄恩典</u>
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

路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2024 年 11 月 4 日证监许可【2024】1539 号《关于准予路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，本基金由基金管理人依照《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《路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金基金合同》的规定公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。基金管理人和注册登记机构均为路博迈基金管理（中国）有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。有关基金募集文件已按规定向中国证监会备案，基金合同于 2024 年 12 月 19 日正式生效，生效日的基金份额总额为 4,426,706,571.25 份，经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验字第 2400607 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，包括债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、信用衍生品、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票等权益类资产，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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。

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，同时亦按照中国证券投资基金

基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、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 2026 年 6 月 30 日的财务状况、自 2026 年 1 月 1 日至 2026 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[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 号文《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[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为,可以选择适用简易计税方法,按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖债券取得的收入,自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日,免

征增值税；对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。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	4,185,656.62
等于：本金	4,185,577.45
加：应计利息	79.17
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	2,739.80
等于：本金	2,739.80
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,188,396.42

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 2026 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	5,137,775.68	106,334.25	5,246,334.25	2,224.32
	银行间市场	62,033,700.00	405,808.21	62,470,808.21	31,300.00
	合计	67,171,475.68	512,142.46	67,717,142.46	33,524.32
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		67,171,475.68	512,142.46	67,717,142.46	33,524.32

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 2026 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	8,196.75
其中：交易所市场	-
银行间市场	8,196.75
应付利息	-
预提费用-审计费	19,835.79
预提费用-信息披露费	59,507.37

合计	87,539.91
----	-----------

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

路博迈悦航 30 天持有债券 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,036,506.98	23,036,506.98
本期申购	45,802,064.56	45,802,064.56
本期赎回（以“-”号填列）	-50,983,422.81	-50,983,422.81
本期末	17,855,148.73	17,855,148.73

路博迈悦航 30 天持有债券 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,851,279.24	54,851,279.24
本期申购	214,454,728.61	214,454,728.61
本期赎回（以“-”号填列）	-219,231,020.63	-219,231,020.63
本期末	50,074,987.22	50,074,987.22

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、根据《路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金基金合同》和《路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金对每份基金份额设置 30 天的最短持有期。对于每份基金份额，最短持有期起始日指基金合同生效日（对认购份额而言）或每份基金份额申购申请确认日（对申购份额而言）或基金份额转换转入确认日（对转换转入份额而言）；最短持有期到期日指该基金份额最短持有期起始日起 30 天后的对应日。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

路博迈悦航 30 天持有债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	432,744.28	-11,351.43	421,392.85
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	432,744.28	-11,351.43	421,392.85
本期利润	147,196.12	34,053.75	181,249.87
本期基金份额交易产生的变动数	-136,433.83	-8,357.62	-144,791.45
其中：基金申购款	934,109.10	22,579.34	956,688.44
基金赎回款	-1,070,542.93	-30,936.96	-1,101,479.89
本期已分配利润	-	-	-

本期末	443,506.57	14,344.70	457,851.27
路博迈悦航 30 天持有债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	915,884.52	-26,340.23	889,544.29
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	915,884.52	-26,340.23	889,544.29
本期利润	403,358.87	61,540.57	464,899.44
本期基金份额交易产生的变动数	-235,814.64	5,566.87	-230,247.77
其中：基金申购款	3,870,171.85	118,179.98	3,988,351.83
基金赎回款	-4,105,986.49	-112,613.11	-4,218,599.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,083,428.75	40,767.21	1,124,195.96

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,123.96
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	43.39
结算备付金利息收入	51,957.68
其他	-
合计	54,125.03

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	892,685.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-66,451.99
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	826,233.41

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	544,012,996.08
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	537,859,402.45
减：应计利息总额	6,202,533.46
减：交易费用	17,512.16
买卖债券差价收入	-66,451.99

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 2026年1月1日至2026年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	19,081.10
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	19,081.10

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	5,396,490.84
减：卖出资产支持证券成本总额	5,375,000.00
减：应计利息总额	21,490.84
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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	95,594.32
股票投资	-
债券投资	95,594.32
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	95,594.32

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	7,918.72
账户维护费_中债登	9,000.00
账户维护费_上清所	9,600.00

合计	105,861.88
----	------------

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、关联关系

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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
路博迈基金管理（中国）有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	99,291.27	1,001,334.88
其中：应支付销售机构的客户维护	46,694.47	499,712.41

费		
应支付基金管理人的净管理费	52,596.80	501,622.47

注：支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值 0.20%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：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	24,822.79	250,333.78

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	路博迈悦航 30 天持 有债券 A	路博迈悦航 30 天持 有债券 C	合计
中国银行股份有限公司	-	51,402.07	51,402.07
合计	-	51,402.07	51,402.07
获得销售服务费的各关 联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	路博迈悦航 30 天持 有债券 A	路博迈悦航 30 天持 有债券 C	合计
中国银行股份有限公司	-	821,427.68	821,427.68
合计	-	821,427.68	821,427.68

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。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 0.20%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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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

本基金本报告期末及上年度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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
	4,185,656.62	2,123.96	126,489.74	3,670.08

注：本基金的银行存款由基金托管人中国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（2026 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 2026 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 3,500,919.89 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
220208	22 国开 08	2026 年 07 月 02 日	101.42	37,000	3,752,560.27
合计				37,000	3,752,560.27

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	—	19,951,000.00
合计	—	19,951,000.00

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	—	5,382,209.86
A-1 以下	—	—
未评级	—	—
合计	—	5,382,209.86

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。

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	5,246,334.25	—
AAA 以下	—	—
未评级	62,470,808.21	70,483,967.12
合计	67,717,142.46	70,483,967.12

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、未评级债券为政策性金融债、国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 2026 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	4,188,396.42	-	-	-	4,188,396.42
结算备付金	1,258,278.70	-	-	-	1,258,278.70
交易性金融资产	10,142,054.79	57,575,087.67	-	-	67,717,142.46
应收申购款	-	-	-	100.00	100.00
资产总计	15,588,729.91	57,575,087.67	-	100.00	73,163,917.58
负债					
卖出回购金融资产款	3,500,919.89	-	-	-	3,500,919.89
应付赎回款	-	-	-	30,239.98	30,239.98
应付管理人报酬	-	-	-	15,259.75	15,259.75
应付托管费	-	-	-	3,814.92	3,814.92
应付销售服务费	-	-	-	12,484.78	12,484.78
应交税费	-	-	-	1,475.17	1,475.17
其他负债	-	-	-	87,539.91	87,539.91
负债总计	3,500,919.89	-	-	150,814.51	3,651,734.40
利率敏感度缺口	12,087,810.02	57,575,087.67	-	-150,714.51	69,512,183.18
上年度末 2025 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	27,818.40	-	-	-	27,818.40
结算备付金	1,653,321.02	-	-	-	1,653,321.02
交易性金融资产	75,820,722.19	19,996,454.79	-	-	95,817,176.98
应收申购款	-	-	-	208,460.00	208,460.00
资产总计	77,501,861.61	19,996,454.79	-	208,460.00	97,706,776.40
负债					
卖出回购金融资产款	16,002,462.24	-	-	-	16,002,462.24
应付赎回款	-	-	-	2,354,155.87	2,354,155.87
应付管理人报酬	-	-	-	16,830.72	16,830.72
应付托管费	-	-	-	4,207.71	4,207.71
应付销售服务费	-	-	-	11,203.85	11,203.85
应交税费	-	-	-	2,522.93	2,522.93
其他负债	-	-	-	116,669.72	116,669.72

负债总计	16,002,462.24	-	-	2,505,590.80	18,508,053.04
利率敏感度缺口	61,499,399.37	19,996,454.79	-	-2,297,130.80	79,198,723.36

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；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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）	
	市场利率上升 25 个基点	-395,638.74	-291,642.88	
	市场利率下降 25 个基点	400,056.60	294,699.04	

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	67,717,142.46	95,817,176.98
第三层次	-	-
合计	67,717,142.46	95,817,176.98

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 2026 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	67,717,142.46	92.56
	其中：债券	67,717,142.46	92.56
	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	5,446,675.12	7.44
8	其他各项资产	100.00	0.00
9	合计	73,163,917.58	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	62,470,808.21	89.87
	其中：政策性金融债	62,470,808.21	89.87
4	企业债券	5,246,334.25	7.55
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	67,717,142.46	97.42

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	210405	21 农发 05	200,000	21,923,293.15	31.54
2	240313	24 进出 13	200,000	20,338,284.93	29.26
3	220208	22 国开 08	100,000	10,142,054.79	14.59
4	09250202	25 国开清发 02	100,000	10,067,175.34	14.48
5	148428	23 蛇口 04	50,000	5,246,334.25	7.55

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

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金将结合对宏观经济形势和证券趋势的判断，通过对债券市场进行定性和定量的分析，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货来提高投资组合的运作效率。在国债期货投资过程中，本基金将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。

7.10.2 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中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚，中国农业发展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的处罚，中国进出口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、国家外汇管理局北京市分局的处罚。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约定的备选股票库

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	100.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	100.00

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

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 (%)
路博迈悦航 30 天持有债券 A	156	114,456.08	-	-	17,855,148.73	100.0000
路博迈悦航 30 天持有债券 C	429	116,724.91	-	-	50,074,987.22	100.0000
合计	581	116,919.34	-	-	67,930,135.95	100.0000

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	路博迈悦航 30 天持有债券 A	80,566.84	0.4512
	路博迈悦航 30 天持有债券 C	-	-
	合计	80,566.84	0.1186

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	路博迈悦航 30 天持有债券 A	0
	路博迈悦航 30 天持有债券 C	0

	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	路博迈悦航 30 天持有债券 A	0~10
	路博迈悦航 30 天持有债券 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	路博迈悦航 30 天持有债券 A	路博迈悦航 30 天持有债券 C
基金合同生效日 （2024 年 12 月 19 日）基金份额总额	578,332,252.49	3,848,374,318.76
本报告期期初基金份额总额	23,036,506.98	54,851,279.24
本报告期基金总申购份额	45,802,064.56	214,454,728.61
减：本报告期基金总赎回份额	50,983,422.81	219,231,020.63
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	17,855,148.73	50,074,987.22

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。

本报告期内，基金托管人未发生重大人事变动。

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

本基金自基金合同生效以来聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内管理人无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	2	-	-	1,227.16	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 基金租用或者通过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(%)
东方证券	12,271,550.28	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	关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-01-14
2	路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
3	路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2026-03-02
4	路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金招募说明书更新（2026 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2026-03-03
5	路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026-03-03
6	路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026-03-03
7	路博迈基金管理（中国）有限公司关于旗下部分基金新增易方达财富管理基金销售（广州）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	2026-03-13
8	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（2025 年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-30
9	路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-30
10	路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
11	路博迈基金管理（中国）有限公司	中国证监会规定媒介	2026-04-23

	关于旗下部分基金新增华宝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		
12	2025 年度路博迈基金管理（中国）有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定媒介	2026-04-24
13	路博迈基金管理（中国）有限公司关于旗下部分基金新增汇添富基金销售（上海）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	2026-06-23

§ 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	20260515-20260517	-	29,477,312.55	29,477,312.55	-	-
个人	2	20260402-20260513	-	35,262,023.70	35,262,023.70	-	-
	3	20260310-20260311	-	33,401,410.91	33,401,410.91	-	-
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四舍五入。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告截止日至报告送出日之间，基金管理人发生如下高级管理人员变动：基金管理人于 2026 年 8 月 1 日发布《路博迈基金管理（中国）有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2026 年 7 月 30 日起，刘铮女士担任公司督察长，林海申先生因个人原因不再担任公司督察长。
--

§ 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

2026 年 8 月 28 日