

博道和祥多元稳健债券型证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09月30日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2024年10月25日

目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要财务指标	4
3.2 基金净值表现	5
§4 管理人报告	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	6
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 公平交易专项说明	8
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	8
4.5 报告期内基金的业绩表现	9
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	9
§5 投资组合报告	9
5.1 报告期末基金资产组合情况	9
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	10
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细	11
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	11
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	12
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细	12
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	12
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	12
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	12
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	12
5.11 投资组合报告附注	12
§6 开放式基金份额变动	15
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	15
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	15
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	15
§8 备查文件目录	16
8.1 备查文件目录	16
8.2 存放地点	16
8.3 查阅方式	16

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年07月01日起至2024年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博道和祥多元稳健债券
基金主代码	017134
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年04月11日
报告期末基金份额总额	106,976,910.26份
投资目标	在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	在正常市场环境中，本基金将综合考虑各大类资产的波动率和各类宏观经济变量，判断周期所处的阶段，对固定收益类资产、权益类资产和现金等大类资产的配置比例进行动态调整，力争通过资产配置降低组合波动性，提高基金资产风险调整后收益。此外，本基金通过细分经济场景构建防御因子，多维度监测市场，当预警可能出现尾部异常风险时降低风险资产的配置以防范净值出现大幅波动的风险。在债券投资方面，本基金债券投资策略主要包括类属配置策略、利率债策略、息差策略、可转换债券和可交换债券投资策略、信用债投资策略（含资产支持证券）等积极的投资策略。在股票投资方面，本基金遵循多因子选股思路，综合考虑基本面

	因子、动量因子、行为金融因子等，对个股的潜在投资价值进行综合评价，挑选评分较高的个股构建组合。同时，动态调整不同因子的配置权重，增强组合的风格适应性。此外，本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金将遵循上述股票投资策略，选择潜在投资价值较高的港股进行投资。本基金的国债期货投资策略和存托凭证投资策略详见法律文件。	
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率×90%+沪深300指数收益率×8%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×2%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博道和祥多元稳健债券A	博道和祥多元稳健债券C
下属分级基金的交易代码	017134	017135
报告期末下属分级基金的份额总额	62,938,761.20份	44,038,149.06份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2024年07月01日 - 2024年09月30日)	
	博道和祥多元稳健债券A	博道和祥多元稳健债券C
1.本期已实现收益	-766,618.72	-562,605.89
2.本期利润	1,828,252.11	1,231,442.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0262	0.0258
4.期末基金资产净值	65,172,609.46	45,332,602.86
5.期末基金份额净值	1.0355	1.0294

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博道和祥多元稳健债券A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.98%	0.35%	1.76%	0.16%	1.22%	0.19%
过去六个月	3.05%	0.29%	2.73%	0.13%	0.32%	0.16%
过去一年	3.63%	0.28%	4.27%	0.11%	-0.64%	0.17%
自基金合同生效起至今	3.55%	0.24%	4.14%	0.10%	-0.59%	0.14%

博道和祥多元稳健债券C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.88%	0.35%	1.76%	0.16%	1.12%	0.19%
过去六个月	2.84%	0.29%	2.73%	0.13%	0.11%	0.16%
过去一年	3.22%	0.28%	4.27%	0.11%	-1.05%	0.17%
自基金合同生效起至今	2.94%	0.24%	4.14%	0.10%	-1.20%	0.14%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博道和祥多元稳健债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年04月11日-2024年09月30日)

注：本基金基金合同生效日为2023年4月11日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

博道和祥多元稳健债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年04月11日-2024年09月30日)

注：本基金基金合同生效日为2023年4月11日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业	说明

		任职日期	离任日期	年限	
陈连权	博道盛利6个月持有期混合、博道和祥多元稳健债券、博道中证同业存单AAA指数7天持有期、博道和裕多元稳健30天持有期债券的基金经理、固定收益投资总监	2023-04-11	-	17年	陈连权先生，中国籍，经济学硕士。2007年8月至2015年5月担任交银施罗德基金管理有限公司投资研究部分析师、专户投资部副总经理，2015年5月至2017年11月担任富国基金管理有限公司固定收益研究部总经理、固定收益专户投资部总经理、固定收益投资总监兼基金经理，2018年2月至2021年12月担任上海远海资产管理有限公司副总经理、投资总监、研究总监。2021年12月加入博道基金管理有限公司，现任固定收益投资总监。具有基金从业资格。自2022年2月9日起担任博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金基金经理至今、自2022年10月25日至2024年9月25日担任博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金基金经理、自2023年4月11日起担任博道和祥多元稳健债券型证券投资基金基金经理至今、自2023年10月24日起担任博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理至今、自2024年8月20日起担任博道和裕多元稳健30天持有期债券型证券投资基金基金经理至今。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，实现投资组合间公平交易分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司交易部和监察稽核部进行日常投资交易行为监控，监察稽核部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，本公司管理的所有投资组合参与交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况共发生2次，经检查未发现异常；本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024年三季度，市场在惯性下跌之后出现V型反转，国内基本面仍处于弱势盘整状态，美联储开启了降息周期，全季看，沪深300上涨16.07%，中证500上涨16.19%，中证1000上涨16.60%；债券方面，十年期国债利率从2.20%下行至2.04%后反弹至2.15%，利率体系总体仍处于低位运行，但波动率跟随风险偏好的变化有所放大。

2024年三季度，经济数据仍处于弱势区域，PMI从6月份49.5下行至8月份的49.1后反弹至9月份的49.8，工业增加值同比增速从6月份的5.3%下行至8月份的4.5%；价格方面，CPI从6月份的0.2%上行至0.6%，PPI则从-0.8%下行至-1.8%，价格延续低位运行；政策方面，9月份下旬，央行加大了货币政策力度，在大力度降准降息的同时，推出了支持股票市场的新工具，且加大了对房地产市场的支持力度，市场预期随之逆转，风险偏好被激活，股票市场出现了V型反转，利率也在降息之后转而上行。

海外方面，美联储开启了降息周期，标志着美联储开始转向宽松周期，但没有对持续性降息给出更多信号，鲍威尔表达了美国暂时不存在衰退风险，似乎暗示了持续激进降息的可能性较低。

往后看，央行的货币政策在力度与工具上出现了可喜的转变，风险偏好在估值低位的环境中出现反跳，有观点将其类比于2009年、2016年等诸多旧周期中的政策转向，并对更大规模的财政刺激抱有较大期待，我们认为，此周期与彼周期并不相同，实质性地促进国内经济循环回升仍是制约利率与股票市场的根本力量，政策的载体与传导路径也已发生了变换，市场可能会经历一个“政策急转向，经济缓修复，资产再平衡”的脉冲过程。

本基金三季度在基金合同约定的资产配置比例范围内总体维持较高的权益比例，风格与选股方面，遵循多因子模型，在成长与价值当中总体保持均衡，市值风格适中，债券配置总体维持中性。本基金将继续坚持攻守兼备的投资思路，积极跟踪把握基本面与市场的变化，保持对市场的尊重及敬畏，秉持勤勉尽责，力争为投资者获得有竞争力的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金份额净值及业绩表现请见"3.1 主要财务指标"及"3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较"部分披露。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	21,478,744.29	15.21
	其中：股票	21,478,744.29	15.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	110,537,668.45	78.30

	其中：债券	110,537,668.45	78.30
	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	4,198,663.48	2.97
	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	4,957,225.08	3.51
8	其他资产	597.62	0.00
9	合计	141,172,898.92	100.00

注：银行存款和结算备付金合计余额包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	29,609.00	0.03
B	采矿业	294,940.00	0.27
C	制造业	13,515,271.21	12.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	609,159.00	0.55
E	建筑业	309,492.00	0.28
F	批发和零售业	325,277.00	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	579,059.00	0.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,767,105.08	2.50
J	金融业	2,086,653.00	1.89
K	房地产业	825,521.00	0.75
L	租赁和商务服务业	27,573.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施	54,653.00	0.05

	管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	54,432.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	21,478,744.29	19.44

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	688095	福昕软件	3,600	240,624.00	0.22
2	688208	道通科技	7,400	234,728.00	0.21
3	688100	威胜信息	5,268	232,845.60	0.21
4	688800	瑞可达	8,025	231,120.00	0.21
5	002139	拓邦股份	19,900	224,870.00	0.20
6	688123	聚辰股份	3,800	223,972.00	0.20
7	605333	沪光股份	7,600	222,072.00	0.20
8	002609	捷顺科技	26,300	221,183.00	0.20
9	002206	海利得	50,800	220,472.00	0.20
10	600909	华安证券	36,700	219,099.00	0.20

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	17,246,764.38	15.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	31,332,582.41	28.35
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	51,813,648.78	46.89

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,144,672.88	9.18
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	110,537,668.45	100.03

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	122737	12石油04	100,000	10,883,191.78	9.85
2	019697	23国债04	100,000	10,603,194.52	9.60
3	2228017	22邮储银行二级01	100,000	10,490,609.32	9.49
4	2228004	22工商银行二级01	100,000	10,447,819.67	9.45
5	2228039	22建设银行二级01	100,000	10,394,153.42	9.41

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期内未进行股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期内未进行国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或者在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(1) 截至本报告期末，22建设银行二级01（证券代码2228039）为本基金持有的前十大证券。2023年11月22日，发行主体中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）因单个网点在同一会计年度内与超过3家保险公司开展保险业务合作等18项主要违法违规事实，收到国家金融监督管理总局没收违法所得并处罚款合计3791.879382万元的行政处罚（金罚决字〔2023〕29号），其中，总行2041.879382万元，分支机构1750万元。2024年1月5日，建设银行因并表管理内部审计存在不足等4项主要违法违规事实，收到国家金融监督管理总局罚款170万元的行政处罚（金罚决字〔2023〕41号）。

截至本报告期末，23中证G3（证券代码138911）为本基金持有的前十大证券。2024年1月5日，发行主体中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）因保荐的恒逸石化股份有限公司（发行人）可转债项目，发行人证券发行上市当年即亏损、营业利润比上年下滑50%以上，被中国证监会采取出具警示函的行政监督管理措施。2024年4月30日，中信证券因知悉客户融券目的是定增套利，配合其提供融券服务，共同违反限制性规定转让“中核钛白”股票，收到中国证监会采取责令改正，给予警告，合计没收违法所得1,910,680.83元，并处以23,250,000元罚款的行政处罚（中国证监会行政处罚决定书〔2024〕45号）。2024年4月30日，中信证券因在担任方大智源科技股份有限公司首次公开发行股票并在创业板上市申请项目保荐人过程中存在违规行为，被深圳证券交易所采取书面警示的自律监管措施（深证函〔2024〕312号）。2024年5月8日，中信证券因作为广东泉为科技股份有限公司首次公开发行股票持续督导机构，在持续督导履职过程中存在违规行为，被广东证监局采取出具警示函的行政监管措施（行政监管措施决定书〔2024〕41号）。2024年8月5日，中信证券因保荐的贵州安达科技能源股份有限公司2023年财务数据未达到选取的上市标准，被贵州证监局采取出具警示函的措施并记入证券期货市场诚信档案（行政监管措施决定书〔2024〕26号），2024年8月23日因相同事项被北京证券交易所监管执行部采取出具警示函的自律监管措施并记入证券期货市场诚信档案数据库（北证监管执行函〔2024〕9号）。

截至本报告期末，21中金G7（证券代码185097）为本基金持有的前十大证券。2024年1月5日，发行主体中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）因作为泰禾集团股份有限公司（以下简称“泰禾集团”）公司债券受托管理人，在受托管理期间未严格遵守执业行为准则，存在未对泰禾集团未披露相关重大债务逾期及诉讼事项保持必要关注、未在年度受托管理事务报告中披露相关重大事项等情形，被证监会采取出具警示函的监督管理措施。2024年1月12日，中金公司因在资产证券化专项计划管理工作中，存在建立基础资产现金流归集机制不到位且管理不善，未能切实防范专项计划现金流被侵占、挪用等问题，被浙江证监局采取出具警示函的监督管理措施，并记入证券期货市场诚信档案。2024年4月24日，中金公司因合规管理存在聘用未取得从业资格的人员开展相关证券业务、对员工行为监测监控不到位等问题，被中国证监会北京监管局采取出具警示函的行政监管措施。2024年4月28日，中金公司因存在自营和投顾账户间发生交易、利益冲突管理不到位、开展场外期权业务不审慎、对子公司业务和投资行为管理不到位、公司治理不规范的情况，反映出公司未能有效实施合规管理，内部控制不完善，

被中国证监会北京监管局采取责令增加合规检查次数的行政监管措施（〔2024〕97号）。2024年5月9日，中金公司因开展资产管理业务时存在因操作风险造成流动性缺口、违规提供通道服务、同日反向交易未列明决策依据、产品账户间互相发生交易等问题，被中国证监会北京监管局采取责令改正的行政监管措施（〔2024〕117号）。2024年8月23日，中金公司因推荐么麻子食品股份有限公司首次公开发行股票并在主板上市的执业过程中存在未充分核查发行人关联方情况、资金流水核查程序存在瑕疵、经销商下游客户走访程序存在瑕疵的违规情形，被深圳证券交易所出具监管函（深证函〔2024〕541号）。2024年9月29日，中金公司因薪酬管理制度不健全、薪酬相关信息披露存在错误、人员任职管理和信息报送存在问题，反映出公司未能有效实施合规管理，被中国证监会北京监管局采取出具警示函的行政监管措施。

本基金认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。

（2）报告期内本基金投资的前十名证券中，其他证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	597.62
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	597.62

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	博道和祥多元稳健债券 A	博道和祥多元稳健债券 C
报告期期初基金份额总额	82,131,879.05	49,817,268.82
报告期期间基金总申购份额	153,732.38	3,550,683.07
减：报告期期间基金总赎回份额	19,346,850.23	9,329,802.83
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	62,938,761.20	44,038,149.06

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	博道和祥多元稳健债券A	博道和祥多元稳健债券C
报告期期初管理人持有的本基金份额	1,999,690.08	1,000,045.00
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,999,690.08	1,000,045.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	3.18	2.27

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则买入/申购总份额中包含该业务；
2、如果本报告期间发生转换出业务，则卖出/赎回总份额中包含该业务；
3、分级基金“报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）”的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。非分级基金“报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）”的计算中，比例的分母采用期末基金份额总额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、转换、红利再投等。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道和祥多元稳健债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道和祥多元稳健债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道和祥多元稳健债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道和祥多元稳健债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道和祥多元稳健债券型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内博道和祥多元稳健债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

8.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站（www.bdfund.cn）查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博道基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-085-2888（免长途话费）。

博道基金管理有限公司

2024年10月25日