

博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金

2023年第4季度报告

2023年12月31日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2024年01月22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	7
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	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 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	13
5.11 投资组合报告附注	13
§6 开放式基金份额变动	14
§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 影响投资者决策的其他重要信息	15
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况	15
§9 备查文件目录	16
9.1 备查文件目录	16
9.2 存放地点	16
9.3 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年1月19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2023年10月01日起至2023年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合
基金主代码	016637
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年10月25日
报告期末基金份额总额	142,861,608.29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	本基金力争通过大类资产配置、在基金合同约定的投资比例范围内动态调整权益资产仓位来降低组合波动性，实现控制波动率的投资目标，从而提高基金资产风险调整后收益。正常市场环境中，本基金采用长期战略资产配置和中期战术资产配置相结合的方式，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。此外，通过细分经济场景构建防御因子，多维度监测市场的尾部异常风险，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。本基金的股指期货投资策略、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×85%+沪深300指数收益率×13%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×2%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合A	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合C
下属分级基金的交易代码	016637	016638
报告期末下属分级基金的份额总额	114,500,923.27份	28,360,685.02份

注：本基金对认/申购、转换转入的每份基金份额设定6个月的最短持有期限，基金份额在最短持有期限内不办理赎回及转换转出业务，最短持有期限为持有期起始日（含）至持有期到期日（不含），自持有期到期日（含该日）起可以提出赎回或转换转出申请。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2023年10月01日 - 2023年12月31日)
--------	--------------------------------

	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合A	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合C
1.本期已实现收益	-906,992.26	-275,904.51
2.本期利润	-1,047,264.02	-337,580.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0089	-0.0103
4.期末基金资产净值	114,152,175.72	28,139,776.79
5.期末基金份额净值	0.9970	0.9922

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

博道和瑞多元稳健6个月持有期混合A净值表现

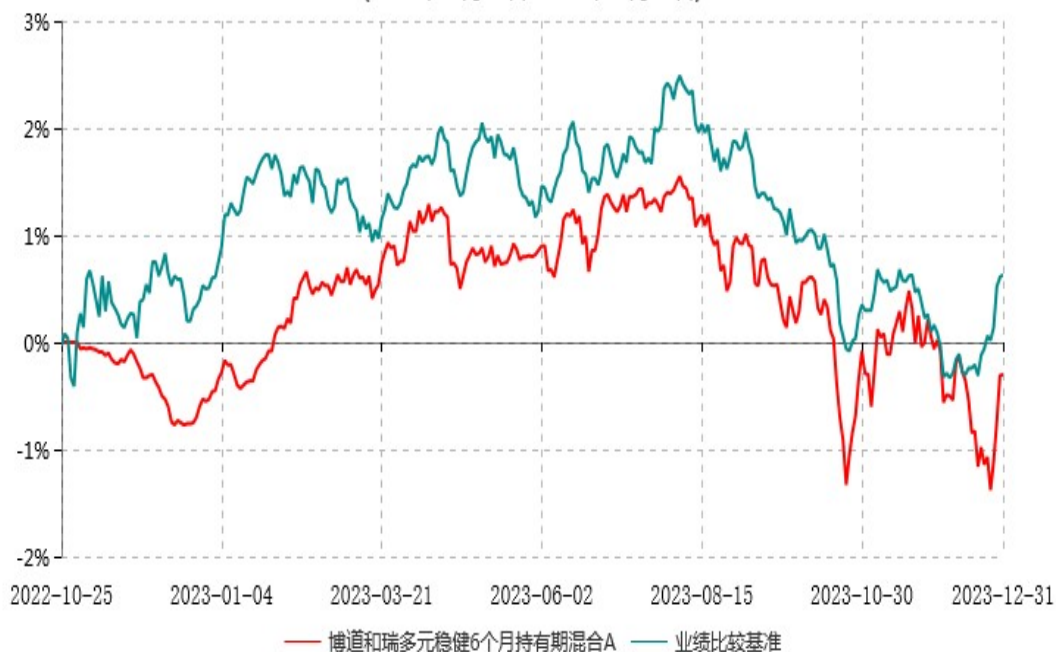
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.86%	0.23%	-0.36%	0.12%	-0.50%	0.11%
过去六个月	-1.53%	0.18%	-0.95%	0.13%	-0.58%	0.05%
过去一年	0.15%	0.15%	0.02%	0.12%	0.13%	0.03%
自基金合同生效起至今	-0.30%	0.14%	0.63%	0.13%	-0.93%	0.01%

博道和瑞多元稳健6个月持有期混合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	-0.96%	0.23%	-0.36%	0.12%	-0.60%	0.11%
过去六个月	-1.73%	0.18%	-0.95%	0.13%	-0.78%	0.05%
过去一年	-0.25%	0.15%	0.02%	0.12%	-0.27%	0.03%
自基金合同生效起至今	-0.78%	0.14%	0.63%	0.13%	-1.41%	0.01%

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

博道和瑞多元稳健6个月持有期混合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
(2022年10月25日-2023年12月31日)



注：本基金基金合同生效日为2022年10月25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。

博道和瑞多元稳健6个月持有期混合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
(2022年10月25日-2023年12月31日)



注：本基金基金合同生效日为2022年10月25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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈连权	博道盛利6个月持有期混合、博道和瑞多元稳健6个月持有期混合、博道和祥多元稳健债券、博道中证同业存单AAA指数7天持有期的基金经理、固定收益投资总监	2022-10-25	-	16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日起担任博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金基金经理至今、自2023年4月11日起担任博道和祥多元稳健债券型证券投资基金基金经理至今、自2023年

					10月24日起担任博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理至今。
--	--	--	--	--	--

4.2 管理人对报告期内本基金运作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1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

2023年四季度，在持续的政策支持下，中国经济在波动中前行，美联储首次发出预示加息结束的鸽派声音，美债利率下行，北向资金仍阶段性施压A股，尽管市场延续惯性下跌，但风险偏好筑底的迹象开始出现。全季看，股票方面，沪深300下跌7.00%，中证500下跌4.60%，中证1000下跌3.15%，债券方面，十年国债利率下行12BP至2.55%，一年期AAA同业存单利率先上后下持平于2.4%附近。

经济基本面方面，四季度经济总体表现出底部波动企稳特征，PMI从9月份的50.2回落至12月的49，而工业增加值同比增速从9月份的4.5%反弹至11月份的6.6%，产成品同比增速从9月份的3.1%回落至11月份的1.7%，CPI与PPI等价格指标有所回踩，PPI在6月探底到同比下降5.4%后改善到9月的-2.5%，后有所反复，又回落到11月-3%左右，总体而言，通胀和库存指标呈现出周期磨底特征；政策方面，一揽子化债、地产需求释放、三大工程、增发国债等政策陆续出台，但可能大部分落地项目在于明年，从建筑业PMI指数看，新订单指数从9月份的50上升至12月份的50.6，业务活动预期指数从9月份的61.8上升至12月份的65.7，尽管市场对地产等长周期问题仍然存在一定的悲观预期，但随着政策的逐步落地，经济周期有望走出底部。本基金在四季度总体维持中等的权益比例，小幅配置了中性策略，减持了部分长久期债券，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，略超配价值与低波因子，市值风格适中。

海外方面，美联储12月议息会议基本宣告加息周期结束，鲍威尔称本次会议讨论了降息时点问题，释放明确降息信号，美联储全面下调2023-2025年通胀预测，或为后续降息进一步铺垫，点阵图显示2024年降息3次，全球流动性或出现转折点，有利于改善新兴市场流动性，可能成为明年市场的另一条波动主线。

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	34,737,250.53	23.87
	其中：股票	34,737,250.53	23.87

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	95,107,263.43	65.35
	其中：债券	95,107,263.43	65.35
	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	9,499,688.90	6.53
	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	5,273,844.64	3.62
8	其他资产	913,311.96	0.63
9	合计	145,531,359.46	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	319,323.00	0.22
B	采矿业	1,327,163.00	0.93
C	制造业	25,088,487.43	17.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,398,750.10	0.98
E	建筑业	97,344.00	0.07
F	批发和零售业	1,347,125.00	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	872,889.00	0.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,347,962.00	1.65
J	金融业	230,644.00	0.16
K	房地产业	135,570.00	0.10
L	租赁和商务服务业	305,256.00	0.21
M	科学研究和技术服务业	109,368.00	0.08

N	水利、环境和公共设施管理业	684,812.00	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	34,272.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	438,285.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	34,737,250.53	24.41

5.2 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	603707	健友股份	42,700	640,500.00	0.45
2	600025	华能水电	62,700	541,101.00	0.38
3	002252	上海莱士	62,600	500,800.00	0.35
4	603283	赛腾股份	5,200	377,312.00	0.27
5	601058	赛轮轮胎	31,200	366,600.00	0.26
6	688271	联影医疗	2,654	363,624.54	0.26
7	601225	陕西煤业	17,200	359,308.00	0.25
8	600480	凌云股份	36,500	332,515.00	0.23
9	002449	国星光电	35,100	332,397.00	0.23
10	002106	莱宝高科	30,300	322,392.00	0.23

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	8,461,261.04	5.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	71,425,785.96	50.20
	其中：政策性金融债	40,480,225.47	28.45
4	企业债券	5,026,311.51	3.53

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,193,904.92	7.16
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	95,107,263.43	66.84

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	230211	23国开11	300,000	30,113,704.92	21.16
2	2228004	22工商银行二级01	100,000	10,432,740.82	7.33
3	230203	23国开03	100,000	10,366,520.55	7.29
4	2028013	20农业银行二级01	100,000	10,259,622.95	7.21
5	2128039	21中国银行二级03	100,000	10,253,196.72	7.21

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市 值(元)	公允价值变 动(元)	风险说明
IC2401	IC2401	-4	-4,349,440.00	520.00	-
IC2403	IC2403	-2	-2,165,840.00	106,480.00	-

公允价值变动总额合计（元）	107,000.00
股指期货投资本期收益（元）	57,388.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）	108,400.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

在法律法规允许的范围内，本基金基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，根据风险管理原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金在本报告期内按照相关法律法规的规定，以套期保值为目的进行股指期货投资，在一定程度上对冲了系统性风险、流动性风险对基金的影响，降低了基金净值的波动。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

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，20农业银行二级01（证券代码2028013）为本基金持有的前十大证券。2023年8月15日，发行主体中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”）因农户贷款发放后流入房地产企业等19项违法违规事实，收到国家金融监督管理总局没收违法所得并处罚款合计4420.184584万元的行政处罚（金罚决字〔2023〕8号），其中，对总行罚款1760.092292万元，没收违法所得60.092292万元，对分支机构罚款2600万元。2023年11月16日，农业银行因流动资金贷款被用于固定资产投资等13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2710.9738万元的行政处罚（金罚决字〔2023〕21号），其中，总行570.9738万元，分支机构2140万元。2023年11月17日，农业银行因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查等4项违法事实，收到国家外汇管理局北京市分局给予警告，没收违法所得1,418,524.70元人民币，并处553万元人民币罚款的行政处罚（京汇罚〔2023〕32号）。

截至本报告期末，21中国银行二级03（证券代码2128039）为本基金持有的前十大证券。2023年2月16日，发行主体中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）因小微企业贷款风险分类不准确等7项违法违规事实收到中国银保监会对总行罚款1600万元，对分支机构罚款1680万元，合计罚款3280万元的行政处罚决定（银保监罚决字〔2023〕5号）。2023年11月29日，中国银行因违反账户管理规定等12项违法行为收到中国人民

银行警告，没收违法所得37.340315万元，罚款3664.2万元的行政处罚（银罚决字〔2023〕93号）。

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	912,139.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,172.76
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	913,311.96

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

	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合A	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合C
报告期期初基金份额总额	121,329,329.00	36,544,934.83
报告期期间基金总申购份额	38,124.14	6,672.26
减：报告期期间基金总赎回份额	6,866,529.87	8,190,922.07

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	114,500,923.27	28,360,685.02

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

	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合A	博道和瑞多元稳健6个月持有期混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	32,925,308.00	1,000,495.00
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	1,000,000.00	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	31,925,308.00	1,000,495.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	27.88	3.53

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

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	转换转出	2023-12-28	-1,000,000.00	-988,900.00	-
合计			-1,000,000.00	-988,900.00	

注：固有资金投资本基金交易适用费率遵守本基金招募说明书有关规定。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者	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	持有基金份额	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

者类别	号	比例达到或者超过20%的时间区间					
机构	1	20231001-20231231	33,925,803.00	-	1,000,000.00	32,925,803.00	23.05%
产品特有风险							
<p>本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。</p>							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金募集注册的文件；

2、《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合同》；

3、《博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金托管协议》；

5、关于申请募集注册博道和瑞多元稳健6个月持有期混合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、报告期内博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

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

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

2024年01月22日