

博时金福安一年持有期混合型发起式基  
金中基金（FOF）  
2021 年第 2 季度报告  
2021 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年七月二十一日

## §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7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2021年4月1日起至6月30日止。

## §2 基金产品概况

|             |  |                   |
|-------------|--|-------------------|
| 基金简称        | 博时金福安一年持有混合（FOF）   |                   |
| 基金主代码       | 010046   |                   |
| 基金运作方式      | 契约型、开放式、发起式  |                   |
| 基金合同生效日     | 2020年9月7日  |                   |
| 报告期末基金份额总额  | 227,561,707.59 份   |                   |
| 投资目标        | 在严格控制组合风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。   |                   |
| 投资策略        | 主要投资策略有资产配置和策略配置。资产配置指本基金依据“经济增长、通胀与货币、市场矛盾与投资者行为”等四个维度的分析框架，研判主要资产的趋势与风险，形成对股票、债券以及大宗商品等资产类别的战略配置意见，以风险等级稳健为目标确定资产配置比例。本基金对被投资基金的投资，重点考察风格特征稳定性、风险控制和合规运作情况，并对照业绩比较基准评价中长期收益、业绩波动和回撤情况。策略配置主要有权益类资产（含股票、股票型基金及混合型基金）投资策略、固收类资产（债券、货币市场基金及债券型基金）投资策略以及商品基金（含商品期货基金和黄金ETF）投资策略。 |                   |
| 业绩比较基准      | 25%*中证股票型基金指数收益率+50%*中证债券型基金指数收益率+10%*上海黄金交易所 AU99.99 收益率+15%*中证货币型基金指数收益率   |                   |
| 风险收益特征      | 本基金为混合型基金中基金，属于中等预期收益和风险水平的投资品种，其预期收益和风险高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金。   |                   |
| 基金管理人       | 博时基金管理有限公司   |                   |
| 基金托管人       | 中国建设银行股份有限公司   |                   |
| 下属分级基金的基金简称 | 博时金福安一年持有混合（FOF）A  | 博时金福安一年持有混合（FOF）C |
| 下属分级基金的交易代码 | 010046   | 010047            |
| 报告期末下属分级基金的 | 226,821,877.32 份   | 739,830.27 份      |

|      |  |  |
|------|--|--|
| 份额总额 |  |  |
|------|--|--|

### §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<br>(2021年4月1日-2021年6月30日) |                        |
|----------------|-------------------------------|------------------------|
|                | 博时金福安一年持有混合<br>(FOF) A        | 博时金福安一年持有混合<br>(FOF) C |
| 1.本期已实现收益      | 3,009,155.62                  | 8,982.61               |
| 2.本期利润         | 6,344,486.73                  | 19,687.09              |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0280                        | 0.0268                 |
| 4.期末基金资产净值     | 243,370,305.99                | 791,251.30             |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0730                        | 1.0695                 |

注：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。

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

###### 1. 博时金福安一年持有混合（FOF）A：

| 阶段                     | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------------------|------------|---------------|----------------|-------------------|--------|-------|
| 过去三<br>个月              | 2.69%      | 0.30%         | 4.19%          | 0.29%             | -1.50% | 0.01% |
| 过去六<br>个月              | 1.14%      | 0.61%         | 2.53%          | 0.40%             | -1.39% | 0.21% |
| 自基金<br>合同生<br>效起至<br>今 | 7.30%      | 0.55%         | 5.26%          | 0.37%             | 2.04%  | 0.18% |

###### 2. 博时金福安一年持有混合（FOF）C：

| 阶段                     | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------------------|------------|---------------|----------------|-------------------|--------|-------|
| 过去三<br>个月              | 2.58%      | 0.30%         | 4.19%          | 0.29%             | -1.61% | 0.01% |
| 过去六<br>个月              | 0.93%      | 0.61%         | 2.53%          | 0.40%             | -1.60% | 0.21% |
| 自基金<br>合同生<br>效起至<br>今 | 6.95%      | 0.55%         | 5.26%          | 0.37%             | 1.69%  | 0.18% |

### 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

#### 1. 博时金福安一年持有混合（FOF）A：



#### 2. 博时金福安一年持有混合（FOF）C：



注：本基金的基金合同于2020年9月7日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（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<br>券从<br>业年<br>限 | 说明   |
|----|-----------------|-------------|------|--------------------|--|
|    |                 | 任职日期        | 离任日期 |                    |  |
| 麦静 | 多元资产管理部总经理/基金经理 | 2020-09-07  | -    | 11.5               | 麦静女士，硕士。CFA。2006年起先后在中铁信托、中国人保资产管理有限公司工作。2020年5月加入博时基金管理有限公司。现任多元资产管理部总经理兼博时颐泽平衡养老目标三年 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 持有期混合型发起式基金中基金（FOF）(2020年9月3日—至今)、博时颐泽稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）(2020年9月3日—至今)、博时金福安一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）(2020年9月7日—至今)的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，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》及其各项实施细则、本基金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、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共13次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度全球经济在波动中延续复苏势头，生产端已逐渐恢复至疫情前水平，消费端加快复苏，供需恢复的结构失衡状况有所缓解，商品和服务贸易持续稳定增长。欧美疫情缓和、疫苗接种加快，但亚洲部分地区疫情有所反复，继续进化的变异株引起关注。以美国为代表的发达经济体复苏速度较快，美股持续创新高，而部分新兴经济体复苏缓慢。全球主要央行延续了前期宽松货币政策，资产负债表持续扩张，金融市场流动性整体宽裕，货币市场利率继续保持低位。美元指数先弱后强，工业原材料类大宗商品价格继续伴随经济复苏预期而大幅上涨。二季度A股市场走势分化，以科创50和创业板指为代表的成长指数涨幅达25%以上，而代表大盘股风格的上证50指数则延续一季度下跌态势，市场风格开始向中小市值扩散。基金方面，主动权益基金在二季度反弹幅度明显，偏股

基金指数上涨 12.75%，混合型基金指数上涨 9.99%，已基本接近春节前市场高点水平，部分偏成长风格和顺周期行业主题基金表现突出，而金融主题基金表现偏弱。债券基金指数和偏债混合基金指数分别录得 1.20%和 2.46%的收益。

报告期内，产品按照既定策略和市场变化进行操作：债券仍保持较低的信用和久期暴露；权益按照以逆向的仓位调整应对震荡的既定策略，在反弹中降低了仓位，并且在结构上增加了红利暴露；黄金阶段性增加了交易头寸但相对于基准仍然低配。

债券方面，利率充分定价了上半年以来宽松的流动性和投资者的配置刚需，使得债券的收益补偿始终处于较低水平。从时间维度来看，经济高点出现后时间相对于债券资产而言是有利的，伴随经济增长和通胀预期回落，债券胜率有望提升；但从收益率角度来看，债券赔率偏低，拉长久期的风险补偿不够。短期内，难觅推动利率大幅下行的因素——经济有韧性、通胀压力仍在、进入下半年“早配早收益”的配置压力减弱、流动性边际上难以更加宽松，综合考虑，维持短久期的机会成本有限，可继续等待更好的进攻时机。

权益方面，基本面兑现了盈利增速的上行预期，这也是春节判断市场不会转向全面熊市的重要依据，叠加超预期的流动性，A股市场出现反弹。但伴随经济增速高点的出现，以及未来逐季减速的盈利增长，基本面对整体权益市场的支撑作用将边际降低。未来市场可能表现出更大波动和更集中且更快速切换的结构性机会，权益投资难度加大。在这种情况下，将继续以逆向仓位调整，以及更加防御的结构和更加灵活的操作策略来进行应对。港股二季度表现弱于A股，尤其恒生科技与国内成长板块表现差异巨大，在创业板指录得 26%收益的同时，恒生科技指数二季度以-0.35%的小幅下跌报收，究其原因，相关上市公司披露的业绩和受到的政策监管是短期走势大相径庭的主因。但回到事物的本质，恒生科技中不乏代表未来发展方向的优质公司，并且无论相对于国内创业板还是美国纳斯达克 100 指数，恒生科技横向比较的估值都有着明显优势，因此阶段性表现偏弱并不影响对港股仍然具有配置价值的中长期判断。

黄金方面，从把握黄金定价的主要矛盾——美债实际利率走势来看，黄金难有趋势性机会，但在利率向上过程中的休整阶段、叠加数字货币暴跌和风险偏好波动时，黄金存在阶段性的交易机会。因此，当黄金在前期显著调整企稳后，4月以把握交易性机会为目的，在组合中加仓了黄金，但相对于基准仍处于低配。6月中下旬在美联储偏向鹰派表述带来货币政策紧缩预期，同时国内对于大宗商品炒作的限制压制了通胀预期，黄金出现快速调整。整体来看，最新价格与成本持平，未来将把握波动机会退出此次交易操作。

三季度可能是观察主导未来资产价格变化驱动力的重要时间窗口，股债过去的走势和目前的价格当中都蕴含着很多矛盾信息：过去一段时间，债券在经济维持复苏、PPI显著上行的过程中由于流动性宽松叠加刚性的配置需求出现上涨，目前债券收益率似乎上下空间都非常有限，但这种情况难以长期维持；过去一段时间，A股在社融增速下降、预期高估值板块可能存在收缩压力的情况下由于短期业绩高增速兑现和资金向小部分“共识资产”聚拢出现局部估值和业绩双击，目前A股估值分化程度基本接近春节高点，从更长的历史经验来看这种情况蕴含的非稳态也难以长期维持。这些矛盾信息大多因为时间维度的错位引致，而未来的市场状态大概率将由其中某些因素打破：也许

是上市公司短期高增速后投资者转向关注盈利减速趋势从而带来估值调整压力，也许是短期通胀未能如期回落后带来长期通胀预期抬头从而抬升通胀预期溢价，无论是什么因素，都可能成为未来一段时间主导资产价格变化的重要变量，在这个过程中，组合将先以防御姿态进行观察，并在更好的价格和时点出手把握各类资产未来的投资机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2021年06月30日，本基金A类基金份额净值为1.0730元，份额累计净值为1.0730元，本基金C类基金份额净值为1.0695元，份额累计净值为1.0695元，报告期内，本基金A类基金份额净值增长率为2.69%，本基金C类基金份额净值增长率为2.58%，同期业绩基准增长率为4.19%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §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                  | -              | -            |
|    | 其中：股票                 | -              | -            |
| 2  | 基金投资                  | 223,125,468.38 | 91.29        |
| 3  | 固定收益投资                | 11,041,732.40  | 4.52         |
|    | 其中：债券                 | 11,041,732.40  | 4.52         |
|    | 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<br>买入返售金融资产 | -              | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付<br>金合计      | 9,837,633.69   | 4.02         |
| 7  | 其他各项资产                | 419,768.35     | 0.17         |
| 8  | 合计                    | 244,424,602.82 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 11,041,732.40 | 4.52         |
|    | 其中：政策性金融债 | 11,041,732.40 | 4.52         |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 11,041,732.40 | 4.52         |

#### 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  | 108604 | 国开 1805 | 110,120 | 11,041,732.40 | 4.52         |

#### 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。



## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除国开 1805(108604)的发行主体外，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。

主要违规事实：2021年1月15日，因存在项目融资业务管理严重违反审慎经营规则的违规行为，中国银行保险监督管理委员会北京监管局对国家开发银行北京分行处以罚款的行政处罚。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

5.11.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定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   | 18,293.38  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 334,380.31 |
| 5  | 应收申购款   | 60,305.71  |
| 6  | 其他应收款   | 6,788.95   |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 419,768.35 |

### 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 基金中基金

### 6.1 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基金投资明细

| 序号 | 基金代码   | 基金名称          | 运作方式   | 持有份额（份）       | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|---------------|--------|---------------|---------------|--------------|------------------------|
| 1  | 002087 | 国富新机遇灵活配置混合 A | 契约型开放式 | 23,553,890.08 | 36,885,391.87 | 15.11%       | 否                      |
| 2  | 050111 | 博时信用债券 C      | 契约型开放式 | 7,599,582.53  | 23,437,112.52 | 9.60%        | 是                      |
| 3  | 159937 | 博时黄金          | 契约型    | 6,306,100.00  | 22,607,368.50 | 9.26%        | 是                      |

|    |        | ETF                  | 开放式        |               |               |       |   |
|----|--------|----------------------|------------|---------------|---------------|-------|---|
| 4  | 003258 | 博时富祥纯债债券A            | 契约型<br>开放式 | 17,842,804.89 | 20,628,066.73 | 8.45% | 是 |
| 5  | 008106 | 博时富瑞纯债债券C            | 契约型<br>开放式 | 18,149,111.32 | 19,243,502.73 | 7.88% | 是 |
| 6  | 003023 | 博时景发纯债债券             | 契约型<br>开放式 | 14,471,535.94 | 15,593,079.98 | 6.39% | 是 |
| 7  | 000085 | 博时安盈债券C              | 契约型<br>开放式 | 8,016,032.06  | 10,001,603.20 | 4.10% | 是 |
| 8  | 004698 | 博时军工主题股票             | 契约型<br>开放式 | 3,755,935.54  | 6,918,433.26  | 2.83% | 是 |
| 9  | 501188 | 汇添富3年封闭运作战略配售混合(LOF) | 契约型<br>开放式 | 5,354,185.00  | 6,623,126.85  | 2.71% | 否 |
| 10 | 000934 | 富兰克林国海大中华精选混合(QDII)  | 契约型<br>开放式 | 2,215,868.79  | 6,499,143.16  | 2.66% | 否 |

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目                   | 本期费用       | 其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用 |
|----------------------|------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元）      | 6,196.44   | -                               |
| 当期交易基金产生的赎回费（元）      | 292,384.26 | 16,134.12                       |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 26,215.91  | 13,571.01                       |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 397,864.69 | 132,489.20                      |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 85,699.93  | 33,900.33                       |
| 开放式基金认购手续费           | -          | -                               |
| 基金交易费用（元）            | 2,079.65   | 1,117.67                        |

注：上述当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费，是根据被投资基金的实际持仓情况和被投资基金的基金合同约定费率估算得出。该三项费用根据被投资基金的基金合同约定已经作为费用计入被投资基金的基金份额净值，已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，

并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

其中，当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生赎回费金额为16,134.12元，属于按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用。

### 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，博时金福安一年持有混合（FOF）所投资的子基金中汇添富3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）发布公告，该基金封闭运作期届满，将转型为汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。

## §7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                 | 博时金福安一年持有混合<br>(FOF) A | 博时金福安一年持有混合<br>(FOF) C |
|--------------------|------------------------|------------------------|
| 本报告期期初基金份额总额       | 226,238,280.37         | 730,184.04             |
| 报告期期间基金总申购份额       | 583,596.95             | 9,646.23               |
| 减：报告期期间基金总赎回份<br>额 | -                      | -                      |
| 报告期期间基金拆分变动份额      | -                      | -                      |
| 本报告期期末基金份额总额       | 226,821,877.32         | 739,830.27             |

## §8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目                               | 博时金福安一年持有混合<br>(FOF) A | 博时金福安一年持有混合<br>(FOF) C |
|----------------------------------|------------------------|------------------------|
| 报告期期初管理人持有的<br>本基金份额             | 10,001,541.82          | -                      |
| 报告期期间买入/申购总份<br>额                | -                      | -                      |
| 报告期期间卖出/赎回总份<br>额                | -                      | -                      |
| 报告期期末管理人持有的<br>本基金份额             | 10,001,541.82          | -                      |
| 报告期期末持有的本基金<br>份额占基金总份额比例<br>(%) | 4.40                   | -                      |

### 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内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。

## §9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|--------------|---------------|--------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,001,541.82 | 4.40%        | 10,001,541.82 | 4.40%        | 3年         |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -            | -             | -            | -          |
| 基金经理等人员     | -             | -            | -             | -            | -          |
| 基金管理人股东     | -             | -            | -             | -            | -          |
| 其他          | -             | -            | -             | -            | -          |
| 合计          | 10,001,541.82 | 4.40%        | 10,001,541.82 | 4.40%        |            |

## §10 影响投资者决策的其他重要信息

### 10.1 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              | 2021-04-01~2021-06-30   | 80,015,444.44 | -    | -    | 80,015,444.44 | 35.16% |
|       | 2              | 2021-04-01~2021-06-30   | 50,011,847.22 | -    | -    | 50,011,847.22 | 21.98% |

#### 产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过

50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

## 10.2 影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至2021年6月30日，博时基金公司共管理276只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾15482亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾4383亿元人民币，累计分红逾1465亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

11.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时金福安一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）设立的文件

11.1.2 《博时金福安一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》

11.1.3 《博时金福安一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》

11.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

11.1.5 博时金福安一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）各年度审计报告正本

11.1.6 报告期内博时金福安一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）在指定报刊上各项公告的原稿

### 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司  
二〇二一年七月二十一日