

# 博远博锐混合型发起式证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:博远基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 27 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月26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2021年01月01日起至2021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.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 中期财务会计报告(未经审计).....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	49

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
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.....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博远博锐混合型发起式证券投资基金	
基金简称	博远博锐混合	
基金主代码	008884	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年07月08日	
基金管理人	博远基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	29,465,061.15份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博远博锐混合A	博远博锐混合C
下属分级基金的交易代码	008884	008885
报告期末下属分级基金的份额总额	26,135,476.55份	3,329,584.60份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金基于基金管理人的投研平台筛选优质上市公司作为主要投资标的，在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，力争获取超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金按照经济增长与通胀理论进行资产配置，同时遵循自下而上的选股策略，采用定性分析和定量分析相结合的方法筛选出优质的上市公司进行投资，并辅助运用多种积极资产增值策略，实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中债综合全价（总值）指数收益率×30%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 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	博远基金管理有限公司	中国银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	杜鹏	许俊
	联系电话	0755-29395888	010-66594319
	电子邮箱	compliance@boyuanfunds.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	0755-29395858	95566	
传真	0755-29395889	010-66594942	
注册地址	深圳市福田区皇岗路5001号 深业上城T2栋4301室	北京市西城区复兴门内大街1号	
办公地址	深圳市福田区皇岗路5001号 深业上城T2栋4301室	北京市西城区复兴门内大街1号	
邮政编码	518000	100818	
法定代表人	钟鸣远	刘连舸	

## 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.boyuanfunds.com
基金中期报告备置地点	深圳市福田区皇岗路5001号深业上城T2栋4301室

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博远基金管理有限公司	深圳市福田区皇岗路5001号深业上城T2栋4301

## §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
---------------	-----

	(2021年01月01日-2021年06月30日)	
	博远博锐混合A	博远博锐混合C
本期已实现收益	758,686.10	94,203.97
本期利润	3,680,767.84	380,459.51
加权平均基金份额本期利润	0.1037	0.1018
本期加权平均净值利润率	11.30%	11.10%
本期基金份额净值增长率	12.20%	11.97%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	-1,518,323.77	-205,763.08
期末可供分配基金份额利润	-0.0581	-0.0618
期末基金资产净值	26,952,376.17	3,420,304.96
期末基金份额净值	1.0313	1.0272
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	3.13%	2.72%

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，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，为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。

### 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

博远博锐混合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
过去一个月	2.31%	1.55%	-1.42%	0.56%	3.73%	0.99%
过去三个月	18.77%	1.42%	2.62%	0.68%	16.15%	0.74%

过去六个月	12.20%	1.47%	0.58%	0.92%	11.62%	0.55%
自基金合同生效起至今	3.13%	1.17%	8.27%	0.89%	-5.14%	0.28%

## 博远博锐混合C

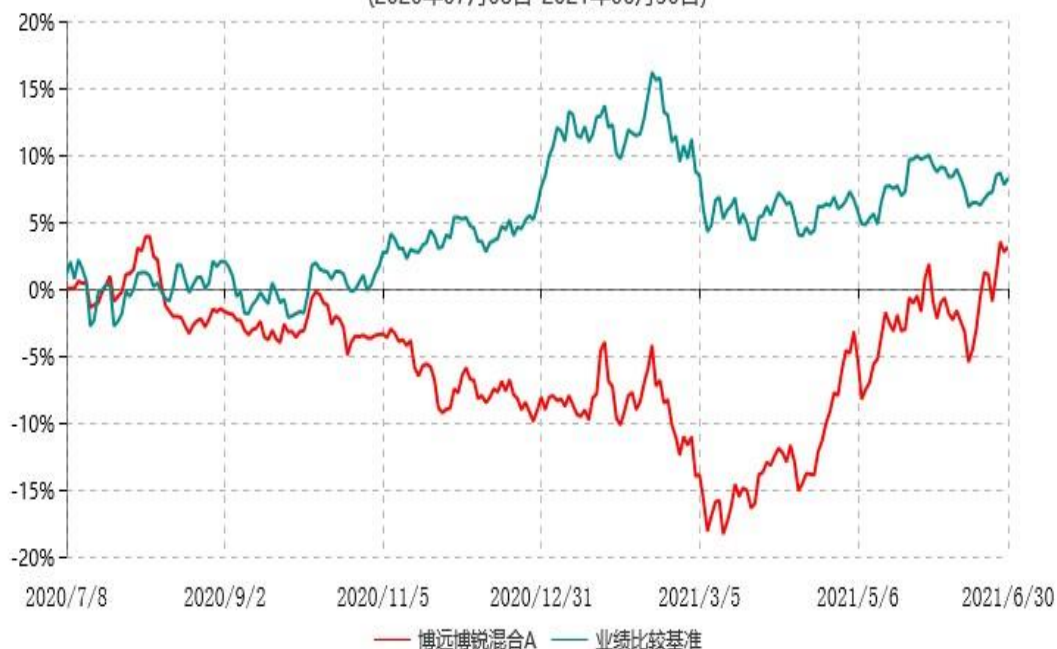
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.27%	1.55%	-1.42%	0.56%	3.69%	0.99%
过去三个月	18.66%	1.42%	2.62%	0.68%	16.04%	0.74%
过去六个月	11.97%	1.47%	0.58%	0.92%	11.39%	0.55%
自基金合同生效起至今	2.72%	1.17%	8.27%	0.89%	-5.55%	0.28%

注：截至报告期末，本基金合同生效时间（2020年7月8日）未满一年。

### 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

博远博锐混合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

(2020年07月08日-2021年06月30日)





博远博锐混合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



注：截至报告期末，本基金合同生效时间（2020年7月8日）未滿一年。本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。本基金建仓期已结束，建仓期结束时，本基金的各项投资组合比例符合基金合同的约定。

## §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

博远基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会证监许可【2018】1920号文批准，于2018年12月12日在深圳注册成立，注册资本1亿元人民币，并于2019年7月1日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。公司目前股东及其出资比例为：钟鸣远先生45.03%，深圳博远协创投资中心（有限合伙）40%，胡隽先生4.99%，黄军锋先生4.99%，姜俊先生4.99%。截止本报告期末，本基金管理人共管理了5只开放式基金。

#### 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	说明
		任职日期	离任日期		

				业 年 限	
钟鸣远	公司总经理、 本基金基金 经理	2020-07-08	-	24 年	钟鸣远先生，中国国籍， 董事，毕业于复旦大学金 融学专业，经济学硕士学 位，具有基金从业资格。 现任博远基金管理有限公司 总经理。历任国家开发 银行深圳分行资金计划部 职员，联合证券有限责任 公司固定收益部投资经 理，泰康人寿保险股份有 限公司固定收益策略研究 员，新华资产管理股份有 限公司固定收益部高级投 资经理，易方达基金管理 有限公司固定收益总部总 经理兼固定收益投资部总 经理，大成基金管理有限 公司副总经理。2019年11 月19日起任博远增强回报 债券型证券投资基金基金 经理。2020年4月15日起兼 任博远双债增利混合型证 券投资基金基金经理。202 0年7月8日起兼任博远博 锐混合型发起式证券投资 基金基金经理。2020年9月 30日起兼任博远鑫享三个 月持有期债券型证券投资 基金基金经理。2021年3月 30日起兼任博远优享混合 型证券投资基金基金经 理。

谭飞	本基金基金经理	2020-07-08	-	5年	谭飞先生，中国国籍，香港理工大学健康技术与信息科学专业博士，具有基金从业资格。历任德勤会计师事务所（特殊普通合伙）审计师、深圳市理邦精密仪器股份有限公司研发及项目经理、深圳前海润泽资产管理有限公司大健康产业分析师、博远基金管理有限公司研究部行业研究主管。2020年7月8日起任博远博锐混合型发起式证券投资基金基金经理。
----	---------	------------	---	----	---

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日。

2、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。

3、本基金基金经理报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、监管规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，基金管理人制定了《博远基金管理有限公司投资组合公平交易管理制度》及《博远基金管理有限公司投资组合异常交易监控与报告制度》。基金管理人旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部门负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，集中交易室负责交易执行，风险监察部

负责事前提醒、事中跟进、事后检查并对交易情况进行合理性分析，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为，本基金管理人管理的所有投资组合不存在组合内及组合间的同日反向交易，在不同时间窗口下相邻交易日（1日内、3日内、5日内）的同向交易及反向交易均未出现异常。

### 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

2021年上半年，国内疫情控制较好，虽然偶尔有所反复，但国内企业经营活动以及居民生活基本恢复正常。货币政策相对宽松，为投资提供了较好的基础。上半年，A股经历大幅调整之后，震荡上涨，上证指数上涨3.40%，沪深300指数上涨0.24%，而创业板指数大涨17.22%，科创50指数上涨14.01%，市场的关注点逐步从传统产业转向创新产业。第一、国内创新企业经历去年疫情影响，但需求不减，渗透率逐步提升，今年经营业绩快速恢复，甚至同比2019年上半年也有较好增长，这里包括创新医疗器械、新能源产业链、光伏产业链、半导体产业链；第二、“卡脖子”的关键原材料得到市场高度认可，这点我们在2021年一季报里重点提到过，这里包括科研、工业里的高端原料、高端试剂，高端制造业里的专用设备，高速发展产业里的关键核心上游原材料、核心零部件；第三、国产替代里高端智能、高附加值的产品被国内、国际市场的认可，该类企业也迎来了较好的发展机遇。

上半年本基金配置了创业板、科创板的创新医疗器械、“卡脖子”的关键原材料、快速发展的制药专用设备等企业，另外也着重配置了行业景气度仍保持较高的CRO/CDMO（医药研发外包/医保研发生产外包）行业的龙头企业、疫苗行业、康复医疗器械；战略配置了血制品行业。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，博远博锐混合A基金份额净值为1.0313元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为12.20%，同期业绩比较基准收益率为0.58%；截至报告期末，博远博锐混合C基金份额净值为1.0272元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为11.97%，同期业绩比较基准收益率为0.58%。

### 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，我们依然看好医疗行业里创新企业的发展。第一、疫苗行业，新冠疫情的持续凸显了疫苗的重要性以及促进了全球对疫苗的重新认识。此次新冠疫情是中国疫苗行业重要的发展契机，新冠疫苗的研发速度史无前例。这对中国疫苗行业既是极大

的考验，也是极大的机遇。我们也看到新技术站上舞台，给整个行业带来新的投资机会。从二类疫苗的渗透率提升、新品种的不断推出、新技术带来的革新等各方面，我们都看好中国疫苗企业未来的发展空间。第二、我们仍然看好CRO/CDMO行业的较快发展，首先国内医药外包的渗透率仍然相对较低；其次，中国的工程师红利为医药外包行业的龙头企业带来较强的国际竞争力，随着部分企业的品牌效应逐步加强，有望进一步抢占国际市场份额；最后，化学化工、生物医药的科研服务行业长期被外资所垄断，未来国内企业有望凭借较高的性价比优势实现快速替代。第三、中高端的创新医疗器械在国内渗透率较快的提升，随着知名度上升，该类企业正凭借接近国际标准的产品质量及较高的性价比快速实现国产替代；其次，综合性平台企业及部分细分赛道龙头企业拥有相对丰富且前沿的研发管线，在目前投融资活跃的资本市场上拥有相对充足的研发经费以及国际化视野的管理层优势，因此仍可以保证此类企业中长期的稳定发展。第四、创新药，国内创新药企业大部分从传统药企转型而来，上半年国家药品带量采购的实施以及即将开展的下半年创新药医保谈判，创新药企承受了一定仿制药利润下滑的业绩压力以及整体的估值压力。但可以看到，国内部分创新药企业的国际化战略才刚开始上演，有望凭借对外授权打开国际市场空间，创新药医保谈判后创快速放量而带来利润释放。

下半年，我们仍将继续通过不断的实地调研，去印证生物医药行业里景气度持续的行业和进一步挖掘价值相对低估、仍处于产业快速增长前期的创新企业；我们仍将把精力放在以低估或合理价格买入具备核心竞争力的优质资产上。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，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。

本基金管理人设有估值委员会，公司基金运营部总经理担任估值委员会主席，权益投资总部、固定收益投资总部、研究部、风险监察部和基金运营部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满三年，《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条关于基金持有人数及基金资产净值的限制性条款不适用于本基金。

### §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”）在博远博锐混合型发起式证券投资基金（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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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地复核，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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### §6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：博远博锐混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	1,479,705.27	1,364,866.29
结算备付金		-	-
存出保证金		2,155,991.72	8,564,765.79
交易性金融资产	6.4.7.2	28,908,568.54	39,246,370.45
其中：股票投资		27,041,381.84	36,514,859.55
基金投资		-	-
债券投资		1,867,186.70	2,731,510.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	38,775.49	60,809.43
应收股利		-	-
应收申购款		67,803.69	27,442.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		32,650,844.71	49,264,254.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,113,843.49	360,344.37
应付管理人报酬		41,905.26	63,399.42
应付托管费		5,587.39	8,453.27
应付销售服务费		1,285.04	1,316.08

应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	0.01
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	115,542.40	100,403.40
负债合计		2,278,163.58	533,916.55
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	29,465,061.15	53,024,658.74
未分配利润	6.4.7.10	907,619.98	-4,294,320.40
所有者权益合计		30,372,681.13	48,730,338.34
负债和所有者权益总计		32,650,844.71	49,264,254.89

注:报告截止日2021年06月30日,基金份额总额29,465,061.15份,其中博远博锐混合A基金份额26,135,476.55份,基金份额净值1.0313元;博远博锐混合C基金份额3,329,584.60份,基金份额净值1.0272元。

## 6.2 利润表

会计主体:博远博锐混合型发起式证券投资基金

本报告期:2021年01月01日至2021年06月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至2021年0 6月30日
<b>一、收入</b>		4,866,365.92
1.利息收入		15,910.83
其中:存款利息收入	6.4.7.11	10,838.08
债券利息收入		5,072.75
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		1,622,014.47



其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,522,641.01
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	2,176.12
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	97,197.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,208,337.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	20,103.34
<b>减：二、费用</b>		805,138.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	269,654.50
2. 托管费	6.4.10.2.2	35,954.09
3. 销售服务费		6,796.62
4. 交易费用	6.4.7.18	435,977.38
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.19	56,755.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,061,227.35
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,061,227.35

注：本基金合同于2020年7月8日生效，上年度可比区间无比较数据，因此利润表只列示2021年1月1日至2021年6月30日数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博远博锐混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	53,024,658.74	-4,294,320.40	48,730,338.34
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	4,061,227.35	4,061,227.35
三、本期基金份额交 易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	-23,559,597.59	1,140,713.03	-22,418,884.56
其中：1.基金申购款	8,643,413.95	-500,099.93	8,143,314.02
2.基金赎回 款	-32,203,011.54	1,640,812.96	-30,562,198.58
四、本期向基金份额 持有人分配利润产生 的基金净值变动 (净值减少以“-”号 填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	29,465,061.15	907,619.98	30,372,681.13

注:本基金合同于2020年7月8日生效,上年度可比区间无比较数据,因此所有者权益变动表只列示2021年1月1日至2021年6月30日数据。

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:

钟鸣远

姜俊

韩晓燕

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

博远博锐混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2913号《关于准予博远博锐混合型证券投资基金注册的批复》以及证监许可[2020]916号《关于准予博远博锐混合型证券投资基金变更注册的批复》注册,由博远基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》

和《博远博锐混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集65,760,604.13元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0517号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博远博锐混合型发起式证券投资基金基金合同》于2020年7月8日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为65,777,525.37份基金份额，其中认购资金利息折合16,921.24份基金份额。本基金的基金管理人为博远基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《博远博锐混合型发起式证券投资基金基金合同》和《博远博锐混合型发起式证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认购/申购费用及销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为博远博锐混合A；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为博远博锐混合C。博远博锐混合A和博远博锐混合C分别设置代码，由于基金费用的不同，博远博锐混合A和博远博锐混合C将分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额之间不得相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博远博锐混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票及存托凭证（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票以及存托凭证）、债券（含国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货和国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具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。本基金的投资组合比例为：本基金股票及存托凭证资产投资的投资比例为基金资产的60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中债综合全价（总值）指数收益率×30%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、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"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博远博锐混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一年年度报告相一致。

#### 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 差错更正的说明

本基金在本报告期无会计差错。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2016]36号《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《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《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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。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,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售

额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对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，股票的股息、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。

(3)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。对基金从上市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。

(4)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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	1,479,705.27
定期存款	-
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	-
合计	1,479,705.27

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	23,343,153.94	27,041,381.84	3,698,227.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,867,186.70	1,867,186.70
	银行间市场	-	-
	合计	1,867,186.70	1,867,186.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	25,210,340.64	28,908,568.54	3,698,227.90

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	106.88
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	38,490.89
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	177.72

合计	38,775.49
----	-----------

注：“其他”为应收券商结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

无。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	911.42
预提费用-审计费	19,835.79
预提费用-信息披露费	84,795.19
其他应付	10,000.00
合计	115,542.40

注：“其他应付”为股票红利提前到账款。

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 博远博锐混合A

金额单位：人民币元

项目 (博远博锐混合A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	48,853,991.14	48,853,991.14
本期申购	4,651,473.22	4,651,473.22
本期赎回(以“-”号填列)	-27,369,987.81	-27,369,987.81
本期末	26,135,476.55	26,135,476.55

##### 6.4.7.9.2 博远博锐混合C

金额单位：人民币元

项目 (博远博锐混合C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	4,170,667.60	4,170,667.60
本期申购	3,991,940.73	3,991,940.73
本期赎回(以“-”号填列)	-4,833,023.73	-4,833,023.73
本期末	3,329,584.60	3,329,584.60

注：1、申购含红利再投(如有)、转换入份额(如有)，赎回含转换出份额(如有)。  
2、根据《博远博锐混合型发起式证券投资基金基金合同》、《博远博锐混合型发起式证券投资基金招募说明书》及《博远博锐混合型发起式证券投资基金开放日常申购(赎回、转换、定期定额投资)业务公告》的相关规定，本基金于2020年7月8日(基金合同生效日)至2020年8月24日止期间未开放基金申购、赎回、定投和转换业务，相关业务自2020年8月25日起开始办理。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 博远博锐混合A

单位：人民币元

项目 (博远博锐混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,482,623.28	532,912.30	-3,949,710.98
本期利润	758,686.10	2,922,081.74	3,680,767.84
本期基金份额交易产生的变动数	2,205,613.41	-1,119,770.65	1,085,842.76
其中：基金申购款	-488,521.88	198,937.50	-289,584.38
基金赎回款	2,694,135.29	-1,318,708.15	1,375,427.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,518,323.77	2,335,223.39	816,899.62

##### 6.4.7.10.2 博远博锐混合C

单位：人民币元

项目 (博远博锐混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
-----------------	-------	-------	---------



上年度末	-389,944.62	45,335.20	-344,609.42
本期利润	94,203.97	286,255.54	380,459.51
本期基金份额交易产生的变动数	89,977.57	-35,107.30	54,870.27
其中：基金申购款	-422,435.33	211,919.78	-210,515.55
基金赎回款	512,412.90	-247,027.08	265,385.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-205,763.08	296,483.44	90,720.36

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	2,147.22
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	8,690.86
合计	10,838.08

注：其中“其他”为券商结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	170,753,296.58
减：卖出股票成本总额	169,230,655.57
买卖股票差价收入	1,522,641.01

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	2,176.12
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	2,176.12

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,790,759.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,728,000.00
减：应收利息总额	60,582.88
买卖债券差价收入	2,176.12

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	97,197.34
基金投资产生的股利收益	-
合计	97,197.34

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1.交易性金融资产	3,208,337.28
——股票投资	3,211,848.18
——债券投资	-3,510.90
——资产支持证券投资	-
——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	3,208,337.28

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	20,103.34
合计	20,103.34

注：1、本基金赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。  
2、基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
----	-------------------------------

交易所市场交易费用	435,977.38
银行间市场交易费用	-
合计	435,977.38

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	24,795.19
汇划手续费	125.00
账户维护费-中债登	12,000.00
合计	56,755.98

#### 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，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露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

本基金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
博远基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

无。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.5 基金交易

无。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

#### 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
	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	269,654.50
其中：支付销售机构的客户维护费	98,985.72

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	35,954.09

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 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

无。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

博远博锐混合A

份额单位：份

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
报告期初持有的基金份额	10,006,750.67
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	10,006,750.67
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	33.96%

博远博锐混合C

份额单位：份

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日

报告期初持有的基金份额	0.00
报告期内申购/买入总份额	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%

注：1、基金管理人投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

2、本基金合同于2020年7月8日生效，上年度可比区间无比较数据，因此只列示2021年1月1日至2021年6月30日数据。

#### 6.4.10.4.2 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

无。

#### 6.4.10.5 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	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	1,479,705.27	2,147.22

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021年06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

无。

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

#### **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**

无。

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### **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**

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中等收益风险特征的基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关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从事风险管理的主要目标是通过灵活的资产配置和主动的投资管理，拓展大类资产配置空间，在精选个股、个券的基础上适度集中投资，在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期稳健增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(公司风险控制委员会)、专业监控(风险监察部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在管理层下设立风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议指导业务部门开展工作；在业务操作层面，风险监察部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行，同时履行风险量化评估分析职责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

##### **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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益不利变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，涉及信用风险的投资品种在入公司备选库前均由信用研究员进行深入的研究支持与风险分析，且基金通过分散化投资以分散信用风险。

于本期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(上年度末：0.08%)。

#### 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,867,186.70	2,691,730.80
合计	1,867,186.70	2,691,730.80

注：未评级部分为国债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	24,546.10

AAA以下	-	15,234.00
未评级	-	-
合计	-	39,780.10

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。

#### 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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。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带来的潜在流动性风险，有效保障基金持有人利益。于本期末，本基金未持有流动性受限资产。且本基金组合资产中7个工作日可变现资产超过最近工作日确认的净赎回金额。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债（如有）的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般

不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,479,705.27	-	-	-	1,479,705.27
存出保证金	2,155,991.72	-	-	-	2,155,991.72
交易性金融资产	1,867,186.70	-	-	27,041,381.84	28,908,568.54
应收利息	-	-	-	38,775.49	38,775.49
应收申购款	-	-	-	67,803.69	67,803.69
资产总计	5,502,883.69	-	-	27,147,961.02	32,650,844.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,113,843.49	2,113,843.49
应付管理人报酬	-	-	-	41,905.26	41,905.26
应付托管费	-	-	-	5,587.39	5,587.39
应付销售服务费	-	-	-	1,285.04	1,285.04
其他负债	-	-	-	115,542.40	115,542.40
负债总计	-	-	-	2,278,163.58	2,278,163.58

利率敏感度缺口	5,502,883.69	-	-	24,869,797.44	30,372,681.13
上年度末 2020年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,364,866.29	-	-	-	1,364,866.29
存出保证金	8,564,765.79	-	-	-	8,564,765.79
交易性金融资产	2,691,730.80	1,546.10	38,234.00	36,514,859.55	39,246,370.45
应收利息	-	-	-	60,809.43	60,809.43
应收申购款	-	-	-	27,442.93	27,442.93
资产总计	12,621,362.88	1,546.10	38,234.00	36,603,111.91	49,264,254.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	360,344.37	360,344.37
应付管理人报酬	-	-	-	63,399.42	63,399.42
应付托管费	-	-	-	8,453.27	8,453.27
应付销售服务费	-	-	-	1,316.08	1,316.08
应交税费	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	100,403.40	100,403.40
负债总计	-	-	-	533,916.55	533,916.55
利率敏感度缺口	12,621,362.88	1,546.10	38,234.00	36,069,195.36	48,730,338.34

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 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。		
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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率上升25个基点	-199.53	-730.79
	市场利率下降25个基点	200.04	740.91

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票及存托凭证资产的投资比例为基金资产的60%-95%。本基金每个交易日日终在扣除指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人定期或不定期运用压力测试对基金进行风险度量，测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产净 值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	27,041,381.84	89.03	36,514,859.55	74.93
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-

一权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	27,041,381.84	89.03	36,514,859.55	74.93

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数收益率以外的其他市场变量保持不变。		
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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	沪深300指数收益率上升 5%	1,449,754.79	1,672,627.60
	沪深300指数收益率下降 5%	-1,449,754.79	-1,672,627.60

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §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	27,041,381.84	82.82
	其中：股票	27,041,381.84	82.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,867,186.70	5.72
	其中：债券	1,867,186.70	5.72
	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	1,479,705.27	4.53
8	其他各项资产	2,262,570.90	6.93
9	合计	32,650,844.71	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

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	23,612,277.08	77.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	182,105.00	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,222,509.76	7.32
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,024,490.00	3.37
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	27,041,381.84	89.03
--	----	---------------	-------

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 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

金额单位：人民币元

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	600276	恒瑞医药	22,200	1,508,934.00	4.97
2	300760	迈瑞医疗	3,000	1,440,150.00	4.74
3	300171	东富龙	32,000	1,300,800.00	4.28
4	300122	智飞生物	6,885	1,285,636.05	4.23
5	300601	康泰生物	8,100	1,206,900.00	3.97
6	688626	翔宇医疗	9,550	1,154,022.00	3.80
7	688301	奕瑞科技	3,904	1,093,120.00	3.60
8	300653	正海生物	13,900	1,088,370.00	3.58
9	300358	楚天科技	58,000	1,085,180.00	3.57
10	603259	药明康德	6,740	1,055,416.60	3.47
11	300347	泰格医药	5,300	1,024,490.00	3.37
12	688198	佰仁医疗	4,383	999,324.00	3.29
13	600161	天坛生物	28,900	989,825.00	3.26
14	688016	心脉医疗	2,169	986,049.09	3.25
15	300685	艾德生物	9,300	967,944.00	3.19
16	300759	康龙化成	4,400	954,756.00	3.14
17	002901	大博医疗	12,500	911,125.00	3.00
18	002690	美亚光电	14,900	830,824.00	2.74
19	688690	纳微科技	5,864	689,020.00	2.27
20	688617	惠泰医疗	1,617	616,060.83	2.03
21	688356	键凯科技	1,802	591,957.00	1.95



22	002415	海康威视	9,000	580,500.00	1.91
23	688029	南微医学	1,828	569,769.32	1.88
24	000739	普洛药业	17,900	526,260.00	1.73
25	002821	凯莱英	1,100	409,860.00	1.35
26	688085	三友医疗	8,437	368,106.31	1.21
27	300558	贝达药业	3,300	357,192.00	1.18
28	300751	迈为股份	760	345,572.00	1.14
29	000403	派林生物	10,279	319,882.48	1.05
30	002223	鱼跃医疗	8,300	316,479.00	1.04
31	300832	新产业	4,900	301,840.00	0.99
32	000915	华特达因	10,700	286,011.00	0.94
33	688133	泰坦科技	668	212,337.16	0.70
34	002727	一心堂	5,500	182,105.00	0.60
35	600079	人福医药	6,300	178,101.00	0.59
36	300452	山河药辅	10,900	162,628.00	0.54
37	600201	生物股份	8,300	144,835.00	0.48

## 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600079	人福医药	4,798,184.00	9.85
2	600161	天坛生物	4,397,510.00	9.02
3	002727	一心堂	3,713,737.00	7.62
4	688356	键凯科技	3,685,738.38	7.56
5	002821	凯莱英	3,629,958.76	7.45
6	300253	卫宁健康	3,591,131.95	7.37
7	688016	心脉医疗	3,463,520.90	7.11
8	300294	博雅生物	3,334,333.30	6.84
9	000739	普洛药业	3,289,352.84	6.75

10	300347	泰格医药	3,102,034.00	6.37
11	300003	乐普医疗	2,970,303.00	6.10
12	300725	药石科技	2,925,880.00	6.00
13	002007	华兰生物	2,916,502.00	5.98
14	000403	派林生物	2,833,522.00	5.81
15	300244	迪安诊断	2,621,842.60	5.38
16	300760	迈瑞医疗	2,573,786.00	5.28
17	603259	药明康德	2,505,176.00	5.14
18	603233	大参林	2,327,027.00	4.78
19	300122	智飞生物	2,219,336.00	4.55
20	688580	伟思医疗	2,202,823.97	4.52
21	002332	仙琚制药	2,185,915.00	4.49
22	688166	博瑞医药	2,145,350.67	4.40
23	300685	艾德生物	2,140,763.00	4.39
24	688179	阿拉丁	1,989,796.69	4.08
25	300482	万孚生物	1,982,030.00	4.07
26	300633	开立医疗	1,963,936.00	4.03
27	300601	康泰生物	1,932,668.00	3.97
28	300451	创业慧康	1,924,073.00	3.95
29	603882	金域医学	1,749,942.00	3.59
30	688202	美迪西	1,738,757.11	3.57
31	600521	华海药业	1,738,412.21	3.57
32	600276	恒瑞医药	1,625,052.84	3.33
33	688301	奕瑞科技	1,602,399.39	3.29
34	600380	健康元	1,536,670.00	3.15
35	002653	海思科	1,469,623.68	3.02
36	688656	浩欧博	1,435,680.83	2.95
37	688617	惠泰医疗	1,412,611.23	2.90
38	603127	昭衍新药	1,384,589.00	2.84
39	600201	生物股份	1,335,433.00	2.74
40	603707	健友股份	1,327,672.00	2.72

41	000513	丽珠集团	1,307,362.80	2.68
42	002223	鱼跃医疗	1,294,181.00	2.66
43	002597	金禾实业	1,255,991.00	2.58
44	002901	大博医疗	1,230,441.00	2.52
45	300759	康龙化成	1,222,243.00	2.51
46	600409	三友化工	1,220,559.00	2.50
47	600867	通化东宝	1,198,440.00	2.46
48	601012	隆基股份	1,195,505.00	2.45
49	300639	凯普生物	1,195,280.00	2.45
50	688085	三友医疗	1,142,225.37	2.34
51	002880	卫光生物	1,140,300.00	2.34
52	603939	益丰药房	1,133,760.00	2.33
53	600195	中牧股份	1,100,989.00	2.26
54	002422	科伦药业	1,045,599.00	2.15
55	300171	东富龙	1,040,761.00	2.14
56	603538	美诺华	1,040,610.00	2.14
57	300358	楚天科技	1,028,067.00	2.11
58	688200	华峰测控	1,010,371.80	2.07
59	603883	老百姓	1,008,122.00	2.07
60	688366	昊海生科	1,006,463.04	2.07
61	300724	捷佳伟创	1,005,638.00	2.06
62	300653	正海生物	994,271.00	2.04
63	600216	浙江医药	984,957.00	2.02
64	300751	迈为股份	982,343.00	2.02

注：本项中“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	600079	人福医药	6,715,843.00	13.78
2	300294	博雅生物	5,551,520.00	11.39
3	688356	键凯科技	5,383,651.22	11.05
4	300725	药石科技	4,197,229.00	8.61
5	688016	心脉医疗	4,098,679.13	8.41
6	300003	乐普医疗	4,053,508.00	8.32
7	002821	凯莱英	3,948,612.00	8.10
8	300253	卫宁健康	3,735,702.00	7.67
9	002727	一心堂	3,525,852.00	7.24
10	600161	天坛生物	3,335,905.00	6.85
11	000739	普洛药业	2,924,875.12	6.00
12	300685	艾德生物	2,853,402.50	5.86
13	002007	华兰生物	2,783,483.00	5.71
14	600409	三友化工	2,768,909.00	5.68
15	300347	泰格医药	2,668,580.00	5.48
16	603259	药明康德	2,441,970.80	5.01
17	300244	迪安诊断	2,404,542.00	4.93
18	000403	派林生物	2,374,639.00	4.87
19	688580	伟思医疗	2,342,938.01	4.81
20	603233	大参林	2,308,905.00	4.74
21	601012	隆基股份	2,294,775.00	4.71
22	002332	仙琚制药	2,208,129.25	4.53
23	300760	迈瑞医疗	2,152,987.00	4.42
24	300122	智飞生物	2,009,803.15	4.12
25	688179	阿拉丁	1,997,772.28	4.10
26	688166	博瑞医药	1,995,935.76	4.10
27	300451	创业慧康	1,959,859.00	4.02
28	300601	康泰生物	1,957,133.10	4.02
29	300482	万孚生物	1,899,215.09	3.90
30	300633	开立医疗	1,871,009.00	3.84
31	688202	美迪西	1,820,634.25	3.74

32	600521	华海药业	1,808,404.00	3.71
33	600276	恒瑞医药	1,776,622.00	3.65
34	688656	浩欧博	1,667,682.18	3.42
35	002653	海思科	1,647,259.00	3.38
36	601939	建设银行	1,545,492.00	3.17
37	603882	金域医学	1,529,517.00	3.14
38	601818	光大银行	1,488,269.00	3.05
39	601398	工商银行	1,487,076.00	3.05
40	600380	健康元	1,470,068.00	3.02
41	000513	丽珠集团	1,462,745.14	3.00
42	002262	恩华药业	1,438,983.46	2.95
43	300406	九强生物	1,424,083.00	2.92
44	603707	健友股份	1,378,718.00	2.83
45	601668	中国建筑	1,351,136.00	2.77
46	600115	中国东航	1,327,614.00	2.72
47	601111	中国国航	1,313,496.00	2.70
48	603127	昭衍新药	1,303,068.00	2.67
49	600029	南方航空	1,295,218.00	2.66
50	688617	惠泰医疗	1,272,094.07	2.61
51	603538	美诺华	1,249,241.00	2.56
52	300759	康龙化成	1,238,686.00	2.54
53	600201	生物股份	1,171,808.00	2.40
54	600867	通化东宝	1,164,746.00	2.39
55	600195	中牧股份	1,144,520.00	2.35
56	603939	益丰药房	1,082,575.00	2.22
57	002880	卫光生物	1,050,190.00	2.16
58	002422	科伦药业	1,041,159.00	2.14
59	688200	华峰测控	1,027,122.94	2.11
60	002223	鱼跃医疗	1,023,035.00	2.10
61	002597	金禾实业	989,210.24	2.03
62	688366	昊海生科	975,130.68	2.00

注：本项中“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	156,545,329.68
卖出股票收入（成交）总额	170,753,296.58

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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	1,867,186.70	6.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	1,867,186.70	6.15

### 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	019640	20国债10	18,670	1,867,186.70	6.15

**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**

无。

**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**

无。

**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**

无。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

无。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

无。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 本报告期内，本基金投资的前十名证券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。

**7.12.2** 本基金投资的前十名股票无超出基金合同规定的备选股票库。

**7.12.3 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	2,155,991.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38,775.49
5	应收申购款	67,803.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,262,570.90

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## §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
博远博锐混合A	925	28,254.57	10,006,750.67	38.29%	16,128,725.88	61.71%
博远博锐混合C	615	5,413.96	0.00	0.00%	3,329,584.60	100.00%
合计	1,488	19,801.79	10,006,750.67	33.96%	19,458,310.48	66.04%

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，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）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 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	博远博锐混合A	104,857.06	0.40%



	博远博锐混合C	-	-
	合计	104,857.06	0.36%

注：上述基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，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	博远博锐混合A	0
	博远博锐混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	博远博锐混合A	0
	博远博锐混合C	0
	合计	0

### 8.4 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	10,006,750.67	33.96%	10,006,750.67	33.96%	3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

合计	10,006,750.67	33.96%	10,006,750.67	33.96%	-
----	---------------	--------	---------------	--------	---

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	博远博锐混合A	博远博锐混合C
基金合同生效日(2020年07月08日)基金份额总额	59,725,903.53	6,051,621.84
本报告期期初基金份额总额	48,853,991.14	4,170,667.60
本报告期基金总申购份额	4,651,473.22	3,991,940.73
减：本报告期基金总赎回份额	27,369,987.81	4,833,023.73
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	26,135,476.55	3,329,584.60

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会，无相关决议。

### 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

#### 1.基金管理人重大人事变动情况

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

#### 2.基金托管人重大人事变动情况

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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，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，本基金投资策略无变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 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

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员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	
安信证券	2	327,235,363.99	100.00%	236,195.02	100.00%	-

注：1、本基金使用证券公司交易结算模式，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》关于交易佣金分仓的规定。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准包括：公司基本面评价（财务情况、经营情况）、公司券商结算模式服务评价（稳定性、及时性）等方面。

3、基金证券经纪商选择程序为：本基金管理人根据上述标准考察后确定选用证券经纪商，并与其签订证券经纪服务协议。

4、报告期内，本基金通过安信证券的专用交易单元进行场内证券交易，无其他新增或停止使用的交易单元。

### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	1,905,375.70	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	博远博锐混合型发起式证券投资基金2020年第四季度报告	规定媒介	2021-01-21
2	博远基金管理有限公司旗下全部基金2020年第4季度报告提示性公告	规定媒介	2021-01-21
3	博远博锐混合型发起式证券投资基金基金合同更新	规定媒介	2021-03-23
4	博远博锐混合型发起式证券投资基金托管协议更新	规定媒介	2021-03-23
5	博远博锐混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新，2021年第1号）	规定媒介	2021-03-23
6	博远博锐混合型发起式证券投资基金2020年年度报告	规定媒介	2021-03-26
7	博远基金管理有限公司关于旗下全部基金2020年年度报告提示性公告	规定媒介	2021-03-26
8	博远博锐混合型发起式证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新	规定媒介	2021-03-26
9	博远博锐混合型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要更新	规定媒介	2021-03-26
10	博远基金管理有限公司旗下部分基金2021年第1季度报告提示性公告	规定媒介	2021-04-21
11	博远博锐混合型发起式证券投资基金2021年第一季度报告	规定媒介	2021-04-21
12	博远基金管理有限公司关于旗下基金参与浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活	规定媒介	2021-04-27

	动的公告		
13	博远基金管理有限公司关于旗下基金参与东方财富证券股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-04-27
14	博远基金管理有限公司关于旗下部分基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2021-04-27
15	博远基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券股份有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2021-04-27
16	博远基金管理有限公司关于旗下基金参与泛华普益基金销售有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-29

## §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	20210108-2021630	10,006,750.67	0.00	0.00	10,006,750.67	33.96%
产品特有风险							
<p>(1) 不能及时应对赎回的风险 持有份额比例较高的基金份额持有人（以下简称“高比例投资者”）大额赎回时，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。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险 当高比例投资者大量赎回时，基金管理人为支付赎回款项而变现基金资产，可能造成资产价格波动，导致本基金资产净值发生波动。若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。若高比例投资者大量赎回本基金，计算基金份额净值时进行四舍五入也可能引起基金份额净值发生波动。</p> <p>(3) 基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。</p> <p>(4) 基金面临转型、合并或提前终止的风险</p>							

高比例投资者赎回后，可能会导致出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满三年，《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条关于基金持有人数及基金资产净值的限制性条款不适用于本基金。

## 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、中国证监会批准博远博锐混合型发起式证券投资基金注册的文件；
- 2、《博远博锐混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《博远博锐混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《博远博锐混合型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新；
- 5、博远基金管理有限公司业务资格批准文件、营业执照；
- 6、本报告期内本基金在符合中国证监会规定条件的全国性报刊上披露的各项公告原件。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路5001号深业上城（南区）T2栋4301 博远基金管理有限公司

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人住所免费查询，或登录中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund/>）及基金管理人网站（<http://www.boyuanfunds.com>）查阅。

博远基金管理有限公司  
二〇二一年八月二十七日