

# 博时汇融回报一年持有期混合型证券投资 基金

2021 年中期报告  
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：江苏银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

## § 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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 1 月 20 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
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.....	11
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
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.....	47
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
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>48</b>
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.....	49
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的情况.....	49
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>52</b>
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.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	博时汇融回报一年持有期混合	
基金主代码	011177	
交易代码	011177	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 20 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	江苏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,143,883,129.70 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时汇融回报一年持有期混合 A	博时汇融回报一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	011177	011178
报告期末下属分级基金的份额总额	4,116,374,165.08 份	27,508,964.62 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现组合资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金为偏股混合型基金。投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、其他资产投资策略三个部分内容。其中，资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，动态调整大类资产配置比例，以争取规避系统性风险。其次，股票投资策略包括行业选择和个股选择，在行业选择层面，主要是结合宏观和政策环境判断，形成行业配置思路。在个股投资层面，本基金将坚持估值与成长相结合，对企业基本面和长期竞争力进行严格评判。其他资产投资策略有债券投资策略、衍生产品投资策略、资产支持证券投资策略、流通受限证券投资策略和参与融资业务的投资策略。
业绩比较基准	<p>本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×10%+中债综合财富(总值)指数收益率×20%。</p> <p>沪深 300 指数对股票市场具有较强的代表性，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。恒生综合指数是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数，可以较好地代表港股市场业绩表现，适合作为本基金港股股票组合的业绩比较基准。中债综合财富(总值)指数能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金固定收益部分的业绩比较基准。基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用如上业绩比较基准能够真实反映本基金的风险收益特征。</p> <p>如果指数编制单位停止计算编制以上指数或更改指数名称、或今后法律法</p>

	规发生变化、或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，在对基金份额持有人无实质不利影响的前提下，本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，调整基金的业绩比较基准，但应在取得基金托管人同意后报中国证监会备案，并及时公告，无须召开基金份额持有人大会审议。
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

### 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		博时基金管理有限公司	江苏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	周宏
	联系电话	0755-83169999	025-58588217
	电子邮箱	service@bosera.com	Zhouhong1@jsbchina.cn
客户服务电话		95105568	95319
传真		0755-83195140	025-58588155
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	南京市中华路 26 号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	南京市中华路 26 号
邮政编码		518040	210001
法定代表人		江向阳	夏平

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

## § 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 1 月 20 日（基金合同生效日）
---------------	------------------------------

	至 2021 年 6 月 30 日)	
	博时汇融回报一年持有期混合 A	博时汇融回报一年持有期混合 C
本期已实现收益	-94,253,892.70	-716,426.92
本期利润	-79,641,393.49	-610,360.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0194	-0.0225
本期加权平均净值利润率	-2.01%	-2.34%
本期基金份额净值增长率	-1.94%	-2.28%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	博时汇融回报一年持有期混合 A	博时汇融回报一年持有期混合 C
期末可供分配利润	-94,270,913.45	-721,257.35
期末可供分配基金份额利润	-0.0229	-0.0262
期末基金资产净值	4,036,627,449.76	26,881,017.48
期末基金份额净值	0.9806	0.9772
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	博时汇融回报一年持有期混合 A	博时汇融回报一年持有期混合 C
基金份额累计净值增长率	-1.94%	-2.28%

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。

期末可供分配利润是指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。

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 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

#### 博时汇融回报一年持有期混合 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	0.56%	0.60%	-1.38%	0.61%	1.94%	-0.01%
过去三个月	5.19%	0.75%	2.72%	0.74%	2.47%	0.01%
自基金合同生效起至今	-1.94%	0.86%	-2.70%	1.01%	0.76%	-0.15%

#### 博时汇融回报一年持有期混合 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	0.49%	0.60%	-1.38%	0.61%	1.87%	-0.01%

过去三个月	4.98%	0.75%	2.72%	0.74%	2.26%	0.01%
自基金合同生效起至今	-2.28%	0.86%	-2.70%	1.01%	0.42%	-0.15%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×10%+中债综合财富(总值)指数收益率×20%。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 70%、10%、20%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

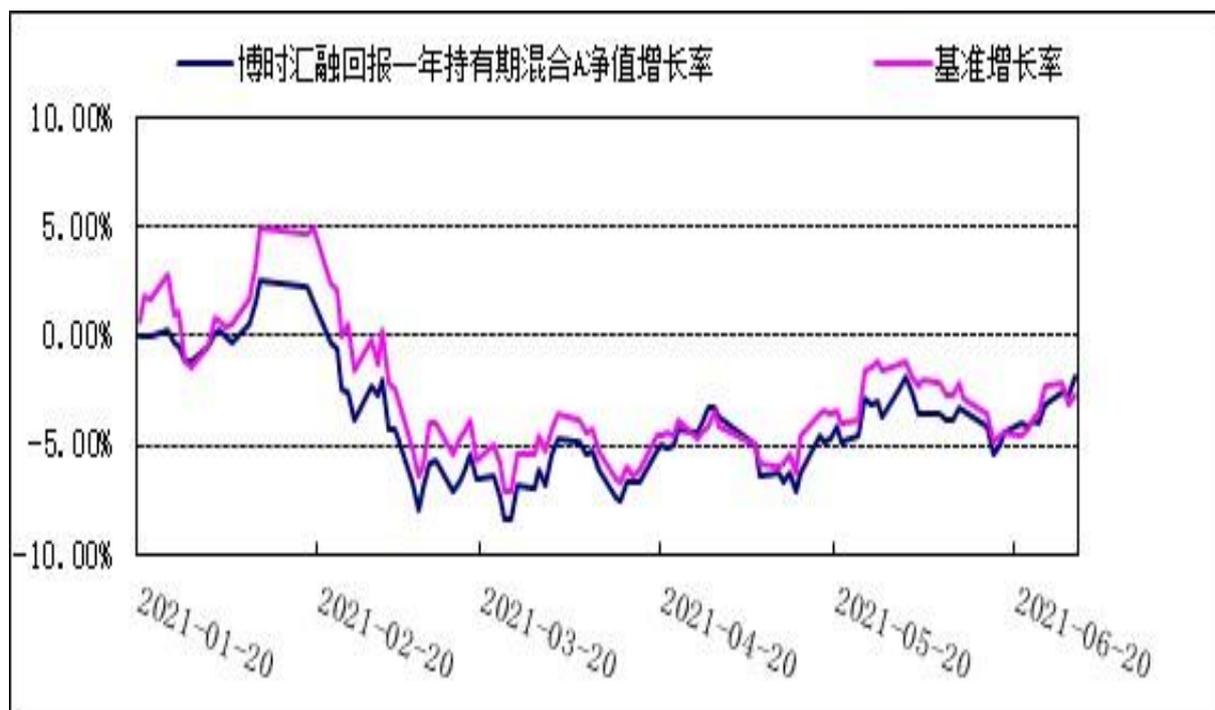
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金

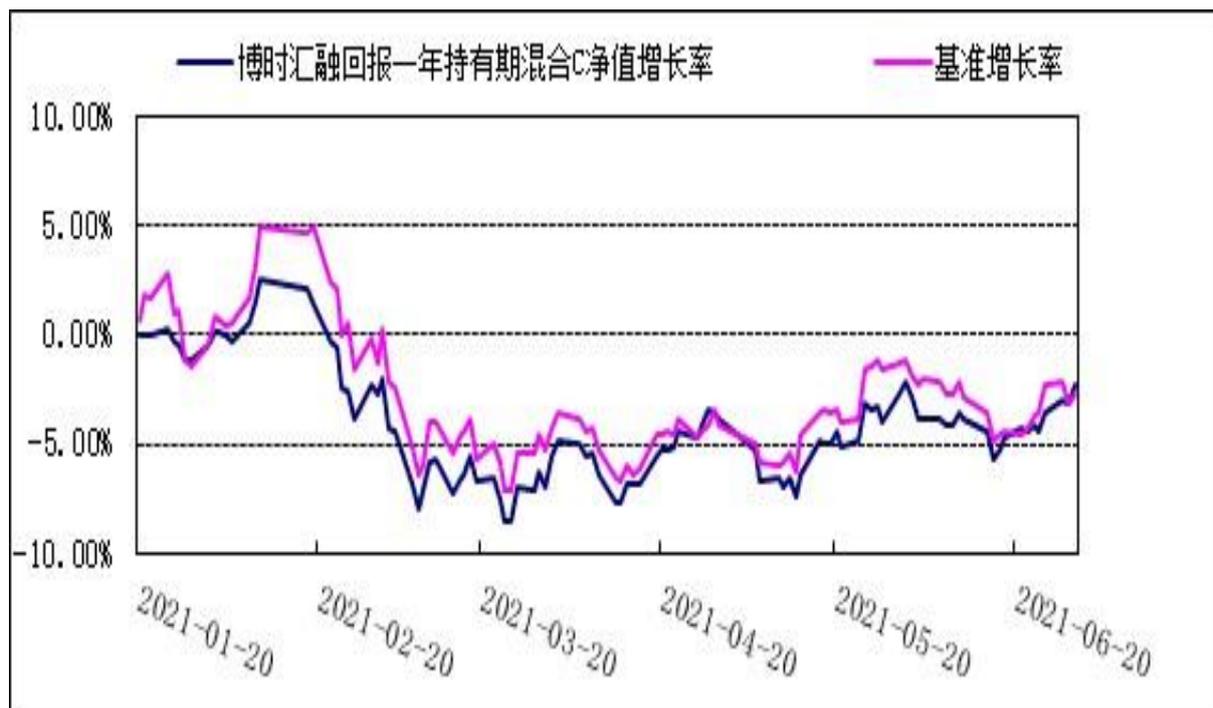
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 1 月 20 日至 2021 年 6 月 30 日)

博时汇融回报一年持有期混合 A



博时汇融回报一年持有期混合 C



注：本基金的基金合同于 2021 年 1 月 20 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。

## § 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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		

吴渭	权益投资主题 组投资副总监 /基金经理	2021-01-20	-	13.9	吴渭先生，硕士。2007 年起先后在泰信基金、博时基金、民生加银基金、招商基金从事投资研究工作。2015 年 3 月再次加入博时基金管理有限公司。历任股票投资部绝对收益组投资副总监、股票投资部主题组投资副总监、事业部投资副总监。现任权益投资主题组投资副总监兼博时汇智回报灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 4 月 12 日一至今)、博时汇悦回报混合型证券投资基金(2019 年 1 月 29 日一至今)、博时汇兴回报一年持有期灵活配置混合型证券投资基金(2021 年 1 月 14 日一至今)、博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金(2021 年 1 月 20 日一至今)、博时汇誉回报灵活配置混合型证券投资基金(2021 年 4 月 29 日一至今)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合规守信情况的说明

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 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

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 24 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 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

上半年整体流动性较好，市场明显呈现出结构性行情的特征，景气度较高的新能源和医药 CXO 行业表现突出；上半年产品回顾：一季度净值经历了大幅波动，二季度整体仓位偏低，处于恢复期，获得一定的绝对收益

展望下半年流动性，我们倾向于从以下角度去理解：（1）首先回顾过去的二季度，整体流动性表现为超预期的友好：货币层面持续维持较为宽松，信用虽然较去年高基数下增速有所下滑但无论是量还是增速仍旧在相对高的水平——除去诸如债券发行节奏等干扰原因，我们倾向于认为政策持续友好的底层原因包括但不限于内需恢复仍旧相对一般且疫情有所反复、国内部分领域仍集聚一些风险，因而无论是在经济恢复层面还是风险稳定方面都承受不住大幅的政策转弯。（2）在此背景上展望下半年流动性：首先货币层面大概率很难比二季度松，后续需要关注部分风险事件对于银行间流动性的阶段性干扰；而信用上预计边际仍旧有所放缓但放缓速度较上半年有所缓和。我们预计下半年内需有韧性但大概率很难更有起色，同时部分领域的风险事件逐步释放使得监管层仍需维持金融大环境的稳定，因而预计下半年整体货币流动性大幅趋严的风险较为一般。后续需要关注部分领域的风险及政策变化节奏、海外流动性预期影响以及大宗商品后续短期波动对通胀预期影响等因素。另外额外需要值得注意，国内包括城投、地产等领域的结构性融资政策变化大背景下，相关产业链可能受其现金流影响而受到部分影响。市场展望：今年以来在疫情反复、宏观复苏、流动性拐点预期等多因素的交织影响下市场波动加剧，由于估值的极致分化，行情在核心资产、顺周期、中小市值等多板块间进行了反复的再平衡。市场中长期收益在时间和标的上均呈现幂律分布，大部分收益由少数优质公司在少数交易日的上涨实现，基于此规律、我们希望寻找能够通过结构性竞争优势持续压制对手的领先型公司、相比美国资本市场 FAANG 六大公司的极致内卷、中国仍有大量产业处在发展的中早期、市场足够纵深，我们仍有足够空间通过适当扩大筛选范围、适度均衡和估值纪律来应对好公司过度拥挤的阶段性局面。同时我们也会关注一些在细分行业的隐形冠军类中小公司。看好持续受益消费升级的免税，中高端白酒等消费子行业，竞争优势可持续积累的生物医药、CXO 等医药细分领域，以及互联网软件中具备生态统治力的长久期基础设施类资产是我们长期看好的生意属性较幸运的板块。高端制造在全球供应链撕裂、重组的背景下也迎来重大机遇期，我们希望捕捉其

中蕴含的两类机会，一是在新能源车、光伏、半导体等总量存在巨大膨胀空间、通过做大蛋糕摆脱内卷僵局的赛道精选具备显著产业链卡位优势和快速迭代能力的公司，二是在总需求相对平稳、技术革新放缓的领域寻找具备较强工匠精神、通过精细化管理和较强性价比持续扩大份额的优质制造龙头。

#### 4.4.2 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 0.9806 元，份额累计净值为 0.9806 元，本基金 C 类基金份额净值为 0.9772 元，份额累计净值为 0.9772 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-1.94%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-2.28%，同期业绩基准增长率为-2.70%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来在疫情反复、宏观复苏、流动性拐点预期等多因素的交织影响下市场波动加剧，由于估值的极致分化，行情在核心资产、顺周期、中小市值等多板块间进行了反复的再平衡。市场中长期收益在时间和标的上均呈现幂律分布，大部分收益由少数优质公司在少数交易日的上涨实现，基于此规律、我们希望寻找能够通过结构性竞争优势持续压制对手的领先型公司、相比美国资本市场 FAANMG 六大公司的极致内卷、中国仍有大量产业处在发展的中早期、市场足够纵深，我们仍有足够空间通过适当扩大筛选范围、适度均衡和估值纪律来应对好公司过度拥挤的阶段性问题。同时我们也会关注一些在细分行业的隐形冠军类中小公司。看好持续受益消费升级的免税，中高端白酒等消费子行业，竞争优势可持续积累的生物医药、CXO 等医药细分领域，以及互联网软件中具备生态统治力的长周期基础设施类资产是我们长期看好的生意属性较幸运的板块。高端制造在全球供应链撕裂、重组的背景下也迎来重大机遇期，我们希望捕捉其中蕴含的两类机会，一是在新能源车、光伏、半导体等总量存在巨大膨胀空间、通过做大蛋糕摆脱内卷僵局的赛道精选具备显著产业链卡位优势和快速迭代能力的公司，二是在总需求相对平稳、技术革新放缓的领域寻找具备较强工匠精神、通过精细化管理和较强性价比持续扩大份额的优质制造龙头。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好

的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述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，由其按约定提供在银行间同业市场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

本报告期内本基金未进行收益分配。

#### 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

无。

## § 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，在托管博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金的过程中，本基金托管人—江苏银行股份有限公司严格遵守《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以及《博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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，本基金托管人—江苏银行股份有限公司未发现博时基金管理有限公司在博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

### 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

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		-
银行存款	6.4.7.1	58,998,388.67
结算备付金		521,289,965.43
存出保证金		1,952,902.38
交易性金融资产	6.4.7.2	3,188,309,344.16
其中：股票投资		2,427,248,161.20
基金投资		-
债券投资		761,061,182.96
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	310,000,000.00
应收证券清算款		95,940.13
应收利息	6.4.7.5	7,435,132.13
应收股利		-
应收申购款		153,714.32
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		4,088,235,387.22
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 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		17,693,368.53
应付赎回款		-
应付管理人报酬		4,922,229.06
应付托管费		820,371.52
应付销售服务费		17,280.39
应付交易费用	6.4.7.7	1,231,709.76
应交税费		4.70
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	41,956.02
负债合计		24,726,919.98
<b>所有者权益：</b>		-
实收基金	6.4.7.9	4,143,883,129.70
未分配利润	6.4.7.10	-80,374,662.46
所有者权益合计		4,063,508,467.24
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>4,088,235,387.22</b>

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 4,143,883,129.70 份。其中 A 类基金份额净值 0.9806 元，基金份额总额 4,116,374,165.08 份；C 类基金份额净值 0.9772 元，基金份额总额 27,508,964.62 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2021 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-45,027,627.65
1. 利息收入		17,193,366.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,543,227.43
债券利息收入		5,484,987.74
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		4,165,151.25
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-76,939,559.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-86,541,293.19
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13.1	14,650.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-

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	9,587,083.93
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	14,718,565.19
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	-
<b>减：二、费用</b>		35,224,126.78
1. 管理人报酬		26,395,372.94
2. 托管费		4,399,228.84
3. 销售服务费		92,164.35
4. 交易费用	6.4.7.18	4,295,003.20
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		1.43
7. 其他费用	6.4.7.19	42,356.02
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-80,251,754.43
减：所得税费用		-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-80,251,754.43

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 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)	4,140,861,131.08	-	4,140,861,131.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-80,251,754.43	-80,251,754.43
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)	3,021,998.62	-122,908.03	2,899,090.59
其中：1. 基金申购款	3,021,998.62	-122,908.03	2,899,090.59
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	4,143,883,129.70	-80,374,662.46	4,063,508,467.24
-----------------	------------------	----------------	------------------

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：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：孙献，会计机构负责人：侣方方

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金（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[2020]3458号《关于准予博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准，由博时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《博时汇融回报一年持有期混合型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基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4,140,861,131.08 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2021）验字第 60669135\_A06 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 1 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,140,861,131.08 份基金份额，其中有效认购资金在募集期间未产生利息。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为江苏银行股份有限公司。

根据《博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》以及《博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购、申购费和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。A 类基金份额、C 类基金份额分别设置代码，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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债、次级债等）、资产支持证券、股指期货、股票期权、国债期货、

信用衍生品、同业存单、债券回购、货币市场工具、银行存款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）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资业务。本基金的投资组合比例：股票资产（含存托凭证）占基金资产的 60%-95%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约所需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。前述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%+恒生综合指数收益率×10%+中债综合财富(总值)指数收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期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本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、

可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支

持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

(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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。

基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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6月30日
活期存款	58,998,388.67
定期存款	-
其他存款	-
合计	58,998,388.67

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,414,709,268.97	2,427,248,161.20	12,538,892.23
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,118,600.00	1,637,182.96
	银行间市场	757,762,910.00	759,424,000.00
	合计	758,881,510.00	761,061,182.96
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,173,590,778.97	3,188,309,344.16	14,718,565.19

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

##### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	310,000,000.00	-

银行间市场	-	-
合计	310,000,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	34,694.05
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	300,436.57
应收债券利息	7,085,561.52
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	-
应收出借证券利息	-
其他	14,439.99
合计	7,435,132.13

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,231,484.76
银行间市场应付交易费用	225.00
合计	1,231,709.76

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用	41,956.02
合计	41,956.02

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 博时汇融回报一年持有期混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	4, 113, 769, 173. 44	4, 113, 769, 173. 44
本期申购	2, 604, 991. 64	2, 604, 991. 64
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4, 116, 374, 165. 08	4, 116, 374, 165. 08

##### 博时汇融回报一年持有期混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	27, 091, 957. 64	27, 091, 957. 64
本期申购	417, 006. 98	417, 006. 98
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	27, 508, 964. 62	27, 508, 964. 62

注：1. 申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

2. 基金合同于 2021 年 1 月 20 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4, 140, 861, 131. 08 份基金份额，无认购资金利息折合的基金份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 博时汇融回报一年持有期混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-94, 253, 892. 70	14, 612, 499. 21	-79, 641, 393. 49
本期基金份额交易产生的变动数	-17, 020. 75	-88, 301. 08	-105, 321. 83
其中：基金申购款	-17, 020. 75	-88, 301. 08	-105, 321. 83
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-94, 270, 913. 45	14, 524, 198. 13	-79, 746, 715. 32

##### 博时汇融回报一年持有期混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-716, 426. 92	106, 065. 98	-610, 360. 94
本期基金份额交易产生的变动数	-4, 830. 43	-12, 755. 77	-17, 586. 20

其中：基金申购款	-4,830.43	-12,755.77	-17,586.20
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-721,257.35	93,310.21	-627,947.14

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月20日（基金合同生效日）至2021年6月 30日
活期存款利息收入	2,293,497.43
定期存款利息收入	1,244,444.44
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,982,263.06
其他	23,022.50
合计	7,543,227.43

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月20日（基金合同生效日）至2021年6月 30日
卖出股票成交总额	810,551,909.26
减：卖出股票成本总额	897,093,202.45
买卖股票差价收入	-86,541,293.19

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 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1月20日（基金合同生效日）至2021年6月 30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	50,000,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	49,740,350.00
减：应收利息总额	245,000.00
买卖债券差价收入	14,650.00

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

无发生额。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

无发生额。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月20日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,587,083.93
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,587,083.93

**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1月20日（基金合同生效日）至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	14,718,565.19
——股票投资	12,538,892.23
——债券投资	2,179,672.96
——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	14,718,565.19

**6.4.7.17 其他收入**

无发生额。

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月20日（基金合同生效日）至2021年6月30日
交易所市场交易费用	4,291,478.20
银行间市场交易费用	3,525.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-

合计	4,295,003.20
----	--------------

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月20日（基金合同生效日）至2021年6月30日
审计费用	37,456.02
信息披露费	-
证券出借违约金	-
中债登账户维护费	4,500.00
其他	400.00
合计	42,356.02

#### 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，本基金无须披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须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
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
江苏银行股份有限公司（“江苏银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2021年1月20日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	3,784,573,115.15	94.82%

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	30,512,000,000.00	96.43%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	2,384,905.18	94.04%	1,080,299.45	87.72%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	26,395,372.94
其中：支付销售机构的客户维护费	13,129,524.93

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
----	---

当期发生的基金应支付的托管费	4,399,228.84
----------------	--------------

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数。}$$

#### 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 2021 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时汇融回报一年持有期混合 A	博时汇融回报一年持有期混合 C	合计
江苏银行	-	20,418.49	20,418.49
博时基金	-	2,331.23	2,331.23
合计	-	22,749.72	22,749.72

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数。}$$

#### 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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
江苏银行	100,222,564.38	-	-	-	-	-

#### 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

无。

##### 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

无。

#### 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

无。

##### 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

无。

**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 2021年1月20日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
江苏银行-活期存款	58,998,388.67	2,293,497.43

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

无。

**6.4.12 期末（2021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**

金额单位：人民币元

**6.4.12.1.1 受限证券类别：股票**

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002413	雷科防务	2021-02-23	2021-08-23	非公开发行限售	5.81	6.51	10,327,022.00	59,999,997.82	67,228,913.22	-
300019	硅宝科技	2021-03-15	2021-09-15	非公开发行限售	13.94	16.84	2,869,441.00	40,000,007.54	48,321,386.44	-
601577	长沙银行	2021-04-02	2021-10-08	非公开发行限售	9.80	8.72	2,040,816.00	19,999,996.80	17,795,915.52	-
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	首次公开发行限售	2.65	5.67	907,763.00	2,405,571.95	5,147,016.21	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	首次公开发行限售	47.33	251.96	853.00	40,372.49	214,921.88	-
688216	气派科技	2021-06-15	2021-12-23	首次公开发行限售	14.82	47.64	2,000.00	29,640.00	95,280.00	-
688621	阳光诺和	2021-06-11	2021-12-21	首次公开发行	26.89	63.99	1,485.00	39,931.65	95,025.15	-

				限售						
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149.00	83,488.65	83,488.65	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	首次公开发行限售	33.22	87.50	925.00	30,728.50	80,937.50	-
688676	金盘科技	2021-03-02	2021-09-09	首次公开发行限售	10.10	16.24	3,750.00	37,875.00	60,900.00	-
688611	杭州柯林	2021-04-01	2021-10-12	首次公开发行限售	33.44	42.34	1,400.00	46,816.00	59,276.00	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926.00	56,550.48	56,550.48	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	首次公开发行限售	48.59	90.39	601.00	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	首次公开发行限售	28.28	115.71	360.00	10,180.80	41,655.60	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789.00	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	首次公开发行限售	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	首次公开发行限售	12.54	27.89	801.00	10,044.54	22,339.89	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	首次公开发行限售	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	首次公开发行限售	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	首次公开发行限售	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-

300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	首次公开发行限售	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	首次公开发行限售	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	首次公开发行限售	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	首次公开发行限售	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	首次公开发行限售	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	首次公开发行限售	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	首次公开发行限售	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	首次公开发行限售	8.53	27.22	300.00	2,559.00	8,166.00	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	首次公开发行限售	8.42	13.60	593.00	4,993.06	8,064.80	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	首次公开发行限售	24.90	24.81	295.00	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	首次公开发行限售	18.24	28.29	245.00	4,468.80	6,931.05	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	首次公开发行限售	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	首次公开发行限售	12.13	22.49	283.00	3,432.79	6,364.67	-

301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	首次公开发行股票限售	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	首次公开发行股票限售	4.54	11.54	507.00	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	首次公开发行股票限售	7.19	12.65	430.00	3,091.70	5,439.50	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行股票限售	10.64	10.64	421.00	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	首次公开发行股票限售	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	首次公开发行股票限售	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	首次公开发行股票限售	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	首次公开发行股票限售	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	首次公开发行股票限售	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	首次公开发行股票限售	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行股票限售	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让；所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%(根据中国证监会《〈关于修改上市公司证券发行管理办法的决定〉〈关于修改创业板上市公司证券发行管理暂行办法的决定〉〈关于修改上市公司非公开发行股票实施细则的决定〉的立法说明》，基金持有的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，不适用上述减持规则的相关规定)；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让

后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

4、本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

#### 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

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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。本基金在控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现组合资产长期稳健的增值。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，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，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，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，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 2021 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	759,424,000.00
合计	759,424,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

##### 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 6 月 30 日
AAA	-
AAA 以下	1,637,182.96
未评级	-
合计	1,637,182.96

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的中期票据、地方政府债。

#### 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于开放期内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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日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。此外，本基金还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。

于本期末，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等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的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

除附注“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不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	58,998,388.67	-	-	-	58,998,388.67
结算备付金	521,289,965.43	-	-	-	521,289,965.43
存出保证金	1,952,902.38	-	-	-	1,952,902.38
交易性金融资产	759,424,000.00	-	1,637,182.96	2,427,248,161.20	3,188,309,344.16

应收证券清算款	-	-	-	95,940.13	95,940.13
买入返售金融资产	310,000,000.00	-	-	-	310,000,000.00
应收利息	-	-	-	7,435,132.13	7,435,132.13
应收申购款	-	-	-	153,714.32	153,714.32
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>1,651,665,256.48</b>	-	<b>1,637,182.96</b>	<b>2,434,932,947.78</b>	<b>4,088,235,387.22</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	17,693,368.53	17,693,368.53
应付管理人报酬	-	-	-	4,922,229.06	4,922,229.06
应付托管费	-	-	-	820,371.52	820,371.52
应付销售服务费	-	-	-	17,280.39	17,280.39
应交税费	-	-	-	4.70	4.70
应付交易费用	-	-	-	1,231,709.76	1,231,709.76
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	41,956.02	41,956.02
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>24,726,919.98</b>	<b>24,726,919.98</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>1,651,665,256.48</b>	-	<b>1,637,182.96</b>	<b>2,410,206,027.80</b>	<b>4,063,508,467.24</b>

表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率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	
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：人民币万元）
		本期末 2021年6月30日
	1. 市场利率下降 25 个基点	增加约 105
	2. 市场利率上升 25 个基点	减少约 105

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 6 月 30 日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	287,935,975.33	287,935,975.33
资产合计	-	287,935,975.33	287,935,975.33
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	287,935,975.33	287,935,975.33

#### 6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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：人民币万元）
		本期末 2021 年 6 月 30 日
	1. 所有港币均相对人民币升值 5%	增加约 1,440
	2. 所有港币均相对人民币贬值 5%	减少约 1,440

#### 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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，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 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,427,248,161.20	59.73
交易性金融资产—债券投资	1,637,182.96	0.04
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	2,428,885,344.16	59.77

注：1. 债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2. 其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制

度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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:人民币万元)
		本期末 2021年6月30日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 420
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 420

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (a) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 2,289,137,676.39 元，属于第二层次的余额为人民币 899,171,667.77 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元。

##### (b) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在第一层次和第二层次之间无重大转换。本基金本报告期持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

(2) 除公允价值外，截至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	2,427,248,161.20	59.37
	其中：股票	2,427,248,161.20	59.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	761,061,182.96	18.62
	其中：债券	761,061,182.96	18.62
	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	310,000,000.00	7.58
	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	580,288,354.10	14.19
8	其他各项资产	9,637,688.96	0.24
9	合计	4,088,235,387.22	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 287,935,975.33 元，净值占比 7.09%。

## 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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,661,202,505.23	40.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	77,753,273.28	1.91
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	24,350.22	0.00
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	74,014,026.93	1.82
J	金融业	97,080,856.31	2.39
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	128,042,166.50	3.15
M	科学研究和技术服务业	86,814,567.15	2.14
N	水利、环境和公共设施管理业	30,146.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	14,313,632.00	0.35
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,139,312,185.87	52.65

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
电信业务	179,455,692.10	4.42
非日常生活消费品	108,480,283.23	2.67
合计	287,935,975.33	7.09

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

**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	占基金资产净值比例 (%)
1	603733	仙鹤股份	4,918,676	186,909,688.00	4.60
2	0700	腾讯控股	369,300	179,455,692.10	4.42
3	601012	隆基股份	1,912,647	169,919,559.48	4.18
4	300122	智飞生物	847,166	158,191,307.18	3.89
5	601888	中国中免	426,665	128,042,166.50	3.15
6	000568	泸州老窖	457,600	107,966,144.00	2.66
7	3690	美团点评-W	362,800	96,721,911.13	2.38
8	603259	药明康德	553,800	86,719,542.00	2.13
9	603678	火炬电子	1,240,689	83,746,507.50	2.06
10	600036	招商银行	1,462,451	79,250,219.69	1.95
11	300760	迈瑞医疗	159,400	76,519,970.00	1.88
12	600025	华能水电	12,537,692	72,593,236.68	1.79
13	603218	日月股份	2,662,354	72,096,546.32	1.77
14	002413	雷科防务	10,327,022	67,228,913.22	1.65
15	600309	万华化学	594,511	64,694,687.02	1.59
16	002415	海康威视	955,500	61,629,750.00	1.52
17	603267	鸿远电子	460,600	58,919,952.00	1.45
18	300750	宁德时代	97,300	52,036,040.00	1.28
19	300019	硅宝科技	2,869,441	48,321,386.44	1.19
20	300782	卓胜微	83,264	44,754,400.00	1.10
21	300409	道氏技术	1,812,500	43,101,250.00	1.06
22	002931	锋龙股份	3,203,008	42,215,645.44	1.04
23	000858	五粮液	141,700	42,211,013.00	1.04
24	603501	韦尔股份	123,600	39,799,200.00	0.98
25	688536	思瑞浦	70,337	38,755,687.00	0.95
26	688386	泛亚微透	614,473	36,100,288.75	0.89
27	603195	公牛集团	164,301	33,188,802.00	0.82
28	000786	北新建材	668,296	26,230,618.00	0.65
29	600570	恒生电子	263,200	24,543,400.00	0.60
30	002791	坚朗五金	117,200	22,742,660.00	0.56
31	600702	舍得酒业	99,700	21,313,866.00	0.52
32	600519	贵州茅台	9,400	19,332,980.00	0.48
33	300014	亿纬锂能	172,831	17,962,325.83	0.44
34	601577	长沙银行	2,040,816	17,795,915.52	0.44
35	300726	宏达电子	242,518	17,095,093.82	0.42
36	300400	劲拓股份	956,500	16,748,315.00	0.41
37	002044	美年健康	1,571,200	14,313,632.00	0.35
38	2333	长城汽车	563,000	11,758,372.10	0.29

39	300896	爱美客	12,900	10,176,552.00	0.25
40	300096	易联众	996,700	9,677,957.00	0.24
41	603168	莎普爱思	929,189	8,687,917.15	0.21
42	688169	石头科技	6,454	8,138,494.00	0.20
43	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.13
44	300957	贝泰妮	8,523	2,298,784.18	0.06
45	688083	中望软件	1,837	1,014,575.10	0.02
46	688216	气派科技	2,000	95,280.00	0.00
47	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.00
48	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
49	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
50	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.00
51	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.00
52	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.00
53	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
54	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
55	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
56	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
57	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
58	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
59	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
60	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
61	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
62	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
63	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
64	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
65	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
66	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
67	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
68	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
69	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
70	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
71	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
72	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
73	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
74	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
75	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
76	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
77	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
78	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
79	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
80	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
81	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00

82	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
83	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
84	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
85	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
86	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
87	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
88	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
89	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
90	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
91	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
92	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	0700	腾讯控股	219,788,829.33	5.41
2	601012	隆基股份	178,001,282.15	4.38
3	603733	仙鹤股份	160,731,200.07	3.96
4	300122	智飞生物	144,276,357.02	3.55
5	603218	日月股份	138,960,503.28	3.42
6	601888	中国中免	131,565,796.77	3.24
7	3690	美团点评-W	121,210,347.23	2.98
8	000568	泸州老窖	110,607,043.63	2.72
9	300124	汇川技术	82,301,981.86	2.03
10	600309	万华化学	78,216,292.77	1.92
11	600036	招商银行	77,808,971.92	1.91
12	603678	火炬电子	75,632,961.62	1.86
13	600025	华能水电	74,238,452.48	1.83
14	300760	迈瑞医疗	68,504,977.45	1.69
15	603259	药明康德	67,394,169.80	1.66
16	002415	海康威视	62,276,740.80	1.53
17	0388	香港交易所	60,574,720.98	1.49
18	002413	雷科防务	59,999,997.82	1.48
19	300413	芒果超媒	58,057,708.46	1.43
20	603267	鸿远电子	54,180,428.55	1.33

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300124	汇川技术	79,041,976.24	1.95
2	601899	紫金矿业	49,826,502.00	1.23
3	0388	香港交易所	49,815,966.18	1.23
4	300413	芒果超媒	49,504,905.00	1.22
5	0027	银河娱乐	45,465,832.07	1.12
6	603392	万泰生物	40,582,301.80	1.00
7	300207	欣旺达	32,540,184.06	0.80
8	000333	美的集团	32,489,528.99	0.80
9	600031	三一重工	27,807,819.00	0.68
10	600346	恒力石化	25,359,674.02	0.62
11	601012	隆基股份	23,632,712.84	0.58
12	0941	中国移动	23,365,212.08	0.58
13	002001	新和成	23,031,269.00	0.57
14	600316	洪都航空	21,723,079.62	0.53
15	002714	牧原股份	21,666,889.00	0.53
16	0883	中国海洋石油	21,488,260.84	0.53
17	605111	新洁能	21,166,197.95	0.52
18	6969	思摩尔国际	20,653,394.52	0.51
19	600426	华鲁恒升	20,240,659.40	0.50
20	603218	日月股份	20,016,874.00	0.49

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（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

买入股票的成本（成交）总额	3,311,802,471.42
卖出股票的收入（成交）总额	810,551,909.26

注：本项“买入股票成本”、“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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	759,424,000.00	18.69
	其中：政策性金融债	759,424,000.00	18.69
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）	1,637,182.96	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	761,061,182.96	18.73

## 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	210201	21 国开 01	4,300,000	430,258,000.00	10.59
2	210301	21 进出 01	2,300,000	230,276,000.00	5.67
3	217701	21 贴现国开 01	1,000,000	98,890,000.00	2.43
4	123111	东财转 3	11,186	1,637,182.96	0.04

## 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。

## 7.11 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。

## 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中除 21 国开 01(210201)、21 进出 01(210301)、腾讯控股(0700)、21 贴现国开 01(217701)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。

主要违规事实：2021 年 4 月 22 日，因存在贷款“三查”不到位的违规行为，中国银行保险监督管理委员会海南监管局对中国进出口银行海南省分行处以罚款的处罚。

主要违规事实：2021 年 3 月 12 日，因存在腾讯控股有限公司收购猿辅导股权案构成未依法申报违法实施的经营者集中，且本案不具有排除、限制竞争的效果的违规行为，国家市场监督管理总局对腾讯控股有限公司处以罚款的公开处罚。

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。

**7.12.2 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。**

### 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	1,952,902.38
2	应收证券清算款	95,940.13
3	应收股利	-
4	应收利息	7,435,132.13
5	应收申购款	153,714.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,637,688.96

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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
博时汇融回报一 年持有期混合 A	32,421	126,966.29	0.00	0.00%	4,116,374,165.08	100.00%
博时汇融回报一 年持有期混合 C	3,011	9,136.16	0.00	0.00%	27,508,964.62	100.00%
合计	35,355	117,207.84	0.00	0.00%	4,143,883,129.70	100.00%

## 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	博时汇融回报一年持有 期混合 A	365,632.41	0.01%
	博时汇融回报一年持有 期混合 C	300,000.00	1.09%
	合计	665,632.41	0.02%

## 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的情况

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时汇融回报一年持有期混合 A	博时汇融回报一年持有期混 合 C
基金合同生效日（2021 年 1 月 20 日）基金份额总额	4,113,769,173.44	27,091,957.64
基金合同生效日起至报告期期末 基金总申购份额	2,604,991.64	417,006.98
减：基金合同生效日起至报告期期 末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末 基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,116,374,165.08	27,508,964.62

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

## 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

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：基金管理人于 2021 年 2 月 6 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，高阳先生担任公司总经理职务。

本报告期内，基金托管人的资产托管部负责人变更为周宏先生。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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未改变。

## 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日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

## 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，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

## 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	
中信证券	2	206,735,303.92	5.18%	151,185.31	5.96%	新增 2 个
招商证券	2	3,784,573,115.15	94.82%	2,384,905.18	94.04%	新增 2 个

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信

息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议

### 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		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
中信证券	-	-	1,130,000,000.00	3.57%	-	-
招商证券	-	-	30,512,000,000.00	96.43%	-	-

### 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	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通邮储银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-29
2	博时基金管理有限公司关于与上海银联电子支付服务有限公司合作开通华夏银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-26
3	关于博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金开通直销网上交易定期投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-28
4	博时基金管理有限公司关于暂停使用通联支付提供的交通银行、平安银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-28
5	博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金开放日常申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-24
6	博时基金管理有限公司关于暂停使用上海银联支付提供的兴业银行、广发银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-24
7	博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-22
8	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行股票的公告 20210406	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-06
9	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-30

	的公告	网站	
10	博时基金管理有限公司关于暂停使用富友支付提供的交通银行快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-20
11	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行股票的公告 20210316	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-16
12	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210310	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-10
13	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行股票的公告 20210224	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-24
14	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210220	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-20
15	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-06
16	关于《博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告》的补充说明	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-22
17	博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-21
18	博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金（博时汇融回报一年持有期混合 A）基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-21
19	博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金（博时汇融回报一年持有期混合 C）基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-21
20	关于博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金提前结束募集的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-18

## § 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

无。

## 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

- 12.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 报告期内博时汇融回报一年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

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 12.3 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  
二〇二一年八月三十一日