

博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资 基金

2022 年中期报告
2022 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：浙商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十一日

§ 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 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 2022 年 2 月 24 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 1 |
| 1.1 重要提示..... | 1 |
| 1.2 目录..... | 2 |
| §2 基金简介 | 4 |
| 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..... | 4 |
| 2.4 信息披露方式..... | 5 |
| 2.5 其他相关资料..... | 5 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 5 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 5 |
| 3.2 基金净值表现..... | 6 |
| §4 管理人报告 | 7 |
| 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..... | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 10 |
| 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 |
| §5 托管人报告 | 12 |
| 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..... | 12 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表..... | 13 |
| 6.2 利润表..... | 14 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 15 |
| 6.4 报表附注..... | 16 |
| §7 投资组合报告 | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 40 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 41 |
| 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..... | 41 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 42 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 45 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 45 |

| | |
|--|-----------|
| 7.12 投资组合报告附注..... | 45 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 46 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 46 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 46 |
| 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..... | 46 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 46 |
| §10 重大事件揭示..... | 47 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 47 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 47 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 47 |
| 10.8 其他重大事件..... | 48 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 49 |
| 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..... | 49 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 50 |
| §12 备查文件目录..... | 50 |
| 12.1 备查文件目录..... | 50 |
| 12.2 存放地点..... | 50 |
| 12.3 查阅方式..... | 50 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---------------------|------------------|
| 基金名称 | 博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 博时恒瑞一年封闭混合 | |
| 基金主代码 | 014554 | |
| 交易代码 | 014554 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2022 年 2 月 24 日 | |
| 基金管理人 | 博时基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 浙商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 211,664,333.19 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 博时恒瑞一年封闭混合 A | 博时恒瑞一年封闭混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 014554 | 014555 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 87,272,838.70 份 | 124,391,494.49 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，以获取绝对收益为核心投资目标，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 | <p>封闭期投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、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、信用衍生品投资策略、参与融资业务的投资策略等内容。</p> <p>开放运作期投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、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、信用衍生品投资策略、参与融资业务的投资策略等内容。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%+中债综合财富（总值）指数收益率×85% |
| 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 | 浙商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 孙麒清 | 朱巍 |
| | 联系电话 | 0755-83169999 | 0571-87659806 |
| | 电子邮箱 | service@bosera.com | zhuwei@czbank.com |
| 客户服务电话 | | 95105568 | 95527 |

| | | |
|-------|-----------------------------------|------------------|
| 传真 | 0755-83195140 | 0571-88268688 |
| 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 | 杭州市萧山区鸿宁路 1788 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 | 杭州市拱墅区延安路 368 号 |
| 邮政编码 | 518040 | 310006 |
| 法定代表人 | 江向阳 | 张荣森(代为履行法定代表人职责) |

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 | http://www.bosera.com |
| 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（2022 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日） | |
|---------------|--|----------------|
| | 博时恒瑞一年封闭混合 A | 博时恒瑞一年封闭混合 C |
| 本期已实现收益 | 330,607.58 | 277,212.07 |
| 本期利润 | 1,058,832.80 | 1,313,764.56 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0121 | 0.0106 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.21% | 1.06% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.21% | 1.06% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) | |
| | 博时恒瑞一年封闭混合 A | 博时恒瑞一年封闭混合 C |
| 期末可供分配利润 | 330,607.58 | 277,212.07 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0038 | 0.0022 |
| 期末基金资产净值 | 88,331,671.50 | 125,705,259.05 |
| 期末基金份额净值 | 1.0121 | 1.0106 |

| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022年6月30日) | |
|--------------|------------------|-----------------|
| | 博时恒瑞一年封闭混合 A | 博时恒瑞一年封闭混合 C |
| 基金份额累计净值增长率 | 1.21% | 1.06% |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

博时恒瑞一年封闭混合 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 | 1.01% | 0.16% | 1.08% | 0.16% | -0.07% | 0.00% |
| 过去三个月 | 1.08% | 0.20% | 1.86% | 0.20% | -0.78% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.21% | 0.17% | 0.68% | 0.25% | 0.53% | -0.08% |

博时恒瑞一年封闭混合 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 | 0.97% | 0.16% | 1.08% | 0.16% | -0.11% | 0.00% |
| 过去三个月 | 0.98% | 0.20% | 1.86% | 0.20% | -0.88% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.06% | 0.17% | 0.68% | 0.25% | 0.38% | -0.08% |

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%+中债综合财富（总值）指数收益率×85%。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 10%、5%、85%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

博时恒瑞一年封闭运作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

（2022 年 2 月 24 日至 2022 年 6 月 30 日）

博时恒瑞一年封闭混合 A



博时恒瑞一年封闭混合 C



注：本基金的基金合同于 2022 年 2 月 24 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 2022 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 327 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 16491 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 5557 亿元人民币，累计分红逾 1678 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 | | |
| 邓欣雨 | 混合资产投资部投资总监助理/基金经理 | 2022-02-24 | - | 13.9 | 邓欣雨先生，硕士。2008 年硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任固定收益研究员、固定收益研究员兼基金经理助理、博时聚瑞纯债债券型证券投资基金(2016 年 5 月 26 日-2017 年 11 月 8 日)、博时富祥纯债债券型证券投资基金(2016 年 11 月 10 日-2017 年 11 月 16 日)、博时聚利纯债债券型证券投资基金(2016 年 9 月 18 日-2017 年 11 月 22 日)、博时兴盛货币市场基金(2016 年 12 月 21 日-2017 年 12 月 29 日)、博时泰和债券型证券投资基金(2016 年 5 月 25 日-2018 年 3 月 9 日)、博时兴荣货币市场基金(2017 年 2 月 24 日-2018 年 3 月 19 日)、博时悦楚纯债债券型证券投资基金(2016 年 9 月 9 日-2018 年 4 月 9 日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2015 年 7 月 16 日-2018 年 5 月 5 日)、博时慧选纯债债券型证券投资基金 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>(2016年12月19日-2018年7月30日)、博时慧选纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018年7月30日-2018年8月9日)、博时利发纯债债券型证券投资基金(2016年9月7日-2018年11月6日)、博时景发纯债债券型证券投资基金(2016年8月3日-2018年11月19日)、博时转债增强债券型证券投资基金(2013年9月25日-2019年1月28日)、博时富元纯债债券型证券投资基金(2017年2月16日-2019年2月25日)、博时裕利纯债债券型证券投资基金(2016年5月9日-2019年3月4日)、博时聚盈纯债债券型证券投资基金(2016年7月27日-2019年3月4日)、博时聚润纯债债券型证券投资基金(2016年8月30日-2019年3月4日)、博时富发纯债债券型证券投资基金(2016年9月7日-2019年3月4日)、博时富诚纯债债券型证券投资基金(2017年3月17日-2019年3月4日)、博时富和纯债债券型证券投资基金(2017年8月30日-2019年3月4日)、博时稳悦63个月定期开放债券型证券投资基金(2020年1月13日-2021年2月25日)的基金经理、固定收益总部指数与创新组投资总监助理。现任混合资产投资部投资总监助理兼博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)(2018年4月23日一至今)、博时转债增强债券型证券投资基金(2019年4月25日一至今)、博时稳定价值债券投资基金</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | (2020 年 2 月 24 日一至今)、博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 3 月 6 日一至今)、博时鑫荣稳健混合型证券投资基金(2021 年 12 月 9 日一至今)、博时恒兴一年定期开放混合型证券投资基金(2021 年 12 月 9 日一至今)、博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金(2022 年 2 月 24 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 10 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

上半年受疫情和地产拖累影响，经济增长明显偏弱，低于前期预期，虽然“宽货币”显著，但“宽信用”效果不明显，市场呈现的是债强股弱，股市大幅下跌反弹，转债市场基本跟随股市大节

奏。因为货币宽松，市场流动性充足，确定性的“宽货币”和不确定的“宽信用”情况导致投资者更青睐通过杠杆套息交易短端，而对长端相对谨慎，债券市场收益率期限结构呈陡峭化下行局面。考虑到经济处于下行趋势中，一般企业盈利开启下行周期后股市难有较好表现，但上半年碰上海外高通胀和国内疫情影响，股市阶段性最大调整幅度大超预期，转债市场也大幅波动，如中证转债指数最大回撤幅度达 12%。5 月份开始随着市场对悲观预期的较充分反应和未来复工复产预期下，权益资产出现一波明显的反弹，转债市场也跟随受益。可以看到本轮反弹中电新、汽车等表现突出的板块或产业链，一个共同点在于需求或预期的明显改善，即基本面率先改善方向，而同为波动大的成长板块芯片表现却较为一般，投资需坚持基本面是最重要的考量因素。本基金秉持追求绝对收益和回撤控制相结合的综合考量思路，自上而下做好权益仓位变动控制，重视行业趋势，择券适度分散。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0121 元，份额累计净值为 1.0121 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0106 元，份额累计净值为 1.0106 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 1.21%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 1.06%，同期业绩基准增长率为 0.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，下半年经济步入温和复苏阶段，企业盈利增速见底回升，流动性维持现有宽松局面概率偏大，同时考虑到股市估值具有吸引力，整体认为未来股市机会大于风险，结构更为重要。考虑到可转债市场处于估值中性偏高状态，这一定程度上反映了转债投资者对股市预期相对较为乐观，结合绝对价格和估值看当前可转债性价比偏中性，机会更依赖行业选择或自下而上的正股角度选择，重视结构性交易机会。纯债环境偏中性，考虑到短端债券收益率已偏低，震荡市里长端性价比可能更占优。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人——博时基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 4,013,793.33 |
| 结算备付金 | | 3,238,321.66 |
| 存出保证金 | | 34,588.23 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 181,966,447.36 |
| 其中：股票投资 | | 30,359,754.20 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 151,606,693.16 |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 其他投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 25,000,000.00 |
| 应收清算款 | | 509,351.94 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - |
| 资产总计 | | 214,762,502.52 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
| 负债： | | |
| 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 | | - |
| 应付清算款 | | 426,491.31 |
| 应付赎回款 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 140,021.96 |
| 应付托管费 | | 35,005.47 |
| 应付销售服务费 | | 46,261.29 |
| 应付投资顾问费 | | - |

| | | |
|-----------------|---------|-----------------------|
| 应交税费 | | 5,113.49 |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 72,678.45 |
| 负债合计 | | 725,571.97 |
| 净资产： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 211,664,333.19 |
| 其他综合收益 | | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 2,372,597.36 |
| 净资产合计 | | 214,036,930.55 |
| 负债和净资产总计 | | 214,762,502.52 |

注：1. 报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 211,664,333.19 份。其中 A 类基金份额净值 1.0121 元，基金份额 87,272,838.70 份；C 类基金份额净值 1.0106 元，基金份额 124,391,494.49 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2022 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 |
|---------------------------|----------|---|
| | | 2022 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日 |
| 一、营业总收入 | | 3,327,182.08 |
| 1. 利息收入 | | 1,004,793.19 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 393,842.45 |
| 债券利息收入 | | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 610,950.74 |
| 证券出借利息收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 557,611.18 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -391,582.02 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 704,766.67 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.12 | - |
| 贵金属投资收益 | | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.13 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.14 | 244,426.53 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有） | | - |

| | | |
|----------------------------|----------|--------------|
| 其他投资收益 | | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | 1,764,777.71 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | - |
| 减：二、营业总支出 | | 954,584.72 |
| 1. 管理人报酬 | | 584,756.71 |
| 2. 托管费 | | 146,189.13 |
| 3. 销售服务费 | | 193,242.51 |
| 4. 投资顾问费 | | - |
| 5. 利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.17 | - |
| 7. 税金及附加 | | 1,878.58 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.18 | 28,517.79 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 2,372,597.36 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 2,372,597.36 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | 2,372,597.36 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年2月24日（基金合同生效日）至2022年6月30日 | | | |
|----------------------|--------------------------------------|----------------|--------------|----------------|
| | 实收基金 | 其他综合 收益（若有） | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | - | - | - | - |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 211,664,333.19 | - | - | 211,664,333.19 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | - | - | 2,372,597.36 | 2,372,597.36 |

| | | | | |
|--|----------------|---|--------------|----------------|
| （一）、综合收益总额 | - | - | 2,372,597.36 | 2,372,597.36 |
| （二）、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） | - | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - | - |
| （三）、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） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 211,664,333.19 | - | 2,372,597.36 | 214,036,930.55 |

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：偃方方

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博时恒瑞一年封闭运作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[2021]2771号《关于准予博时恒瑞一年封闭运作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《博时恒瑞一年封闭运作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 211,422,793.22 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2022）验字第 60669135_A03 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 2 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 211,664,333.19 份基金份额，其中认购资金利息折合 241,539.97 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》以及《博时恒瑞一年封闭运作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/申购费用、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；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，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。

本基金基金合同生效后，前一年封闭运作。本基金封闭期自基金合同生效之日起至 12 个月后的对应日（遇非工作日顺延至下一个工作日）的前一日的期间，如该日不存在对应日期的，则延后至下一个工作日。在封闭期内，本基金不接受基金份额的申购和赎回，也不上市交易。封闭期届满后，本基金转为开放式运作，基金名称变更为“博时恒瑞混合型证券投资基金”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括依法发行或上市的股票（包括主板、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、企业债、公司债、地方政府债、政府支持机构债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债等）、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、股票期权、国债期货、信用衍生品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。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金的投资组合比例：在封闭期内，本基金的股票资产（含存托凭证）占基金资产的 0%-30%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；封闭期到期前一个月不受前述比例限制；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。封闭期届满转为开放式运作后，本基金的股票资产（含存托凭证）占基金资产的 0%-30%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约、国债期货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×10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%+中债综合财富（总

值) 指数收益率 \times 85%。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2022 年 8 月 31 日批准报出。

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(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《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 3 号《半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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2022 年 2 月 24 日(基金合同生效日)起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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 2022 年 2 月 24 日(基金合同生效日)起至 2022 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产;

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发

生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整

的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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

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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，

对证券投资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，股权的股息、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。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 4,013,793.33 |
| 等于：本金 | 4,013,349.92 |
| 加：应计利息 | 443.41 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 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 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 4,013,793.33 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|------------------------|----------------|----------------|----------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 29,042,537.69 | - | 30,359,754.20 | 1,317,216.51 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 70,526.07 | 23,897,767.41 | 488,836.28 |
| | 银行间市场 | 126,528,775.08 | 1,221,425.75 | -41,275.08 |
| | 合计 | 149,867,180.14 | 1,291,951.82 | 151,606,693.16 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 178,909,717.83 | 1,291,951.82 | 181,966,447.36 | 1,764,777.71 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 2022 年 6 月 30 日 | |
|-------|------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 25,000,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 25,000,000.00 | - |

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 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022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 | - |
| 应付交易费用 | 44,560.66 |
| 其中：交易所市场 | 42,148.16 |
| 银行间市场 | 2,412.50 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 28,117.79 |
| 合计 | 72,678.45 |

6.4.7.7 实收基金
博时恒瑞一年封闭混合 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年2月24日（基金合同生效日）至2022年6月30日 | |
|---------------|--------------------------------------|---------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 87,272,838.70 | 87,272,838.70 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 87,272,838.70 | 87,272,838.70 |

博时恒瑞一年封闭混合 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年2月24日（基金合同生效日）至2022年6月30日 | |
|---------------|--------------------------------------|----------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 124,391,494.49 | 124,391,494.49 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 124,391,494.49 | 124,391,494.49 |

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 2022 年 2 月 24 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 211,664,333.19 份基金份额，其中认购资金利息折合 241,539.97 份基金份额。

6.4.7.8 未分配利润
博时恒瑞一年封闭混合 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 | 330,607.58 | 728,225.22 | 1,058,832.80 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 330,607.58 | 728,225.22 | 1,058,832.80 |

博时恒瑞一年封闭混合 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 | 277,212.07 | 1,036,552.49 | 1,313,764.56 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 277,212.07 | 1,036,552.49 | 1,313,764.56 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年2月24日（基金合同生效日）至2022年6月30日 |
|-----------|--------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 18,220.35 |
| 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 | 375,529.63 |
| 其他 | 92.47 |
| 合计 | 393,842.45 |

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年2月24日（基金合同生效日）至2022年6月30日 |
|----|--------------------------------------|
| | |

| | |
|------------|---------------|
| 卖出股票成交总额 | 25,782,504.37 |
| 减：卖出股票成本总额 | 26,085,661.83 |
| 减：交易费用 | 88,424.56 |
| 买卖股票差价收入 | -391,582.02 |

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------------|--------------------------------|
| | 2022年2月24日（基金合同生效日）至2022年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 649,183.10 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 55,583.57 |
| 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 | 704,766.67 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------|--------------------------------|
| | 2022年2月24日（基金合同生效日）至2022年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 33,598,852.36 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 33,494,679.36 |
| 减：应计利息总额 | 44,143.74 |
| 减：交易费用 | 4,445.69 |
| 买卖债券差价收入 | 55,583.57 |

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|---|
| | 2022 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 244,426.53 |
| 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 | 244,426.53 |

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|----------------------------|---|
| | 2022 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | 1,764,777.71 |
| ——股票投资 | 1,317,216.51 |
| ——债券投资 | 447,561.20 |
| ——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 | 1,764,777.71 |

6.4.7.16 其他收入

无发生额。

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------|---|
| | 2022 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日 |
| 审计费用 | 20,417.79 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 开户费 | 400.00 |
| 中债登账户维护费 | 4,500.00 |
| 上清所账户维护费 | 3,200.00 |

| | |
|----|-----------|
| 合计 | 28,517.79 |
|----|-----------|

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 |
| 浙商银行股份有限公司（“浙商银行”） | 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 2022年2月24日（基金合同生效日）至2022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 | 43,449,029.28 | 56.49% |

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年2月24日（基金合同生效日）至2022年6月30日 | |
|-------|--------------------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 招商证券 | 33,970,383.71 | 39.37% |

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 2022 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 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 | 1,326,800,000.00 | 22.32% |

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 2022 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 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 | 31,774.18 | 56.49% | 31,774.18 | 75.39% |

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 2022 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 584,756.71 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 228,774.94 |

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 0.80% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 146,189.13 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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 2022 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日 |
|--------------------|---|
|--------------------|---|

| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
|------|------------------|--------------|------------|
| | 博时恒瑞一年封闭混合 A | 博时恒瑞一年封闭混合 C | 合计 |
| 浙商银行 | - | 186,821.71 | 186,821.71 |
| 博时基金 | - | 322.07 | 322.07 |
| 合计 | - | 187,143.78 | 187,143.78 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.45% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.45\% / \text{当年天数}。$$

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

无。

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 2022 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日 | |
|-----------|---|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 浙商银行-活期存款 | 4,013,793.33 | 18,220.35 |

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

6.4.10.8.1 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（2022 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

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

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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在控制风险的前提下，以获取绝对收益为核心投资目标，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

险管理与绩效分析工作，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 2022 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| A-1 | - |
| A-1 以下 | - |
| 未评级 | 4,238,036.80 |
| 合计 | 4,238,036.80 |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

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 2022年6月30日 |
|--------|-------------------|
| AAA | 49,393,265.45 |
| AAA 以下 | 47,155,364.88 |
| 未评级 | 50,820,026.03 |
| 合计 | 147,368,656.36 |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

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(净资产)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 2022 年 6 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 | 4,013,793.33 | - | - | - | 4,013,793. |

| | | | | | |
|----------------|----------------------|-----------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|
| | | | | | 33 |
| 结算备付金 | 3,238,321.66 | - | - | - | 3,238,321.66 |
| 存出保证金 | 34,588.23 | - | - | - | 34,588.23 |
| 交易性金融资产 | 34,437,322.83 | 103,574,379.31 | 13,594,991.02 | 30,359,754.20 | 181,966,447.36 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 509,351.94 | 509,351.94 |
| 买入返售金融资产 | 25,000,000.00 | - | - | - | 25,000,000.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 66,724,026.05 | 103,574,379.31 | 13,594,991.02 | 30,869,106.14 | 214,762,502.52 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 426,491.31 | 426,491.31 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 140,021.96 | 140,021.96 |
| 应付托管费 | - | - | - | 35,005.47 | 35,005.47 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 46,261.29 | 46,261.29 |
| 应交税费 | - | - | - | 5,113.49 | 5,113.49 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 72,678.45 | 72,678.45 |
| 负债总计 | - | - | - | 725,571.97 | 725,571.97 |
| 利率敏感度缺口 | 66,724,026.05 | 103,574,379.31 | 13,594,991.02 | 30,143,534.17 | 214,036,930.55 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约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 2022年6月30日 |
| | 市场利率上升25个基点 | 减少约64 |
| | 市场利率下降25个基点 | 增加约64 |

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，因此无重大外汇风险。

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 2022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 | 30,359,754.20 | 14.18 |
| 交易性金融资产—债券投资 | 19,659,730.61 | 9.19 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - |
| 合计 | 50,019,484.81 | 23.37 |

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，期货投资于相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为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 2022年6月30日 |
| | 业绩比较基准上升5% | 增加约4 |
| | 业绩比较基准下降5% | 减少约4 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022年6月30日 |
|---------------|-------------------|
| 第一层次 | 50,019,484.81 |
| 第二层次 | 131,946,962.55 |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 181,966,447.36 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 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 | 30,359,754.20 | 14.14 |
| | 其中：股票 | 30,359,754.20 | 14.14 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 151,606,693.16 | 70.59 |
| | 其中：债券 | 151,606,693.16 | 70.59 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 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 | 25,000,000.00 | 11.64 |
| | 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 | 7,252,114.99 | 3.38 |
| 8 | 其他各项资产 | 543,940.17 | 0.25 |
| 9 | 合计 | 214,762,502.52 | 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 | 4,610,882.20 | 2.15 |
| C | 制造业 | 15,027,718.00 | 7.02 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 1,274,664.00 | 0.60 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,166,429.00 | 0.54 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,372,990.00 | 1.11 |
| J | 金融业 | 3,728,332.00 | 1.74 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 628,911.00 | 0.29 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,549,828.00 | 0.72 |
| 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 30,359,754.20 | 14.18 |

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 | 002271 | 东方雨虹 | 47,600 | 2,449,972.00 | 1.14 |
| 2 | 002929 | 润建股份 | 66,100 | 2,372,990.00 | 1.11 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 3 | 688599 | 天合光能 | 31,660 | 2,065,815.00 | 0.97 |
| 4 | 601088 | 中国神华 | 52,634 | 1,752,712.20 | 0.82 |
| 5 | 601899 | 紫金矿业 | 168,500 | 1,572,105.00 | 0.73 |
| 6 | 300059 | 东方财富 | 54,340 | 1,380,236.00 | 0.64 |
| 7 | 600938 | 中国海油 | 73,700 | 1,286,065.00 | 0.60 |
| 8 | 601390 | 中国中铁 | 207,600 | 1,274,664.00 | 0.60 |
| 9 | 600276 | 恒瑞医药 | 31,700 | 1,175,753.00 | 0.55 |
| 10 | 002352 | 顺丰控股 | 20,900 | 1,166,429.00 | 0.54 |
| 11 | 002812 | 恩捷股份 | 4,500 | 1,127,025.00 | 0.53 |
| 12 | 002036 | 联创电子 | 73,300 | 1,125,888.00 | 0.53 |
| 13 | 300450 | 先导智能 | 17,800 | 1,124,604.00 | 0.53 |
| 14 | 603259 | 药明康德 | 10,600 | 1,102,294.00 | 0.52 |
| 15 | 600887 | 伊利股份 | 28,200 | 1,098,390.00 | 0.51 |
| 16 | 601633 | 长城汽车 | 29,200 | 1,081,568.00 | 0.51 |
| 17 | 300122 | 智飞生物 | 9,700 | 1,076,797.00 | 0.50 |
| 18 | 300750 | 宁德时代 | 2,000 | 1,068,000.00 | 0.50 |
| 19 | 601009 | 南京银行 | 96,500 | 1,005,530.00 | 0.47 |
| 20 | 603995 | 甬金股份 | 29,100 | 979,506.00 | 0.46 |
| 21 | 601888 | 中国中免 | 2,700 | 628,911.00 | 0.29 |
| 22 | 300558 | 贝达药业 | 10,100 | 614,080.00 | 0.29 |
| 23 | 600926 | 杭州银行 | 31,400 | 470,372.00 | 0.22 |
| 24 | 300759 | 康龙化成 | 4,700 | 447,534.00 | 0.21 |
| 25 | 601838 | 成都银行 | 26,800 | 444,344.00 | 0.21 |
| 26 | 601166 | 兴业银行 | 21,500 | 427,850.00 | 0.20 |
| 27 | 002241 | 歌尔股份 | 1,200 | 40,320.00 | 0.02 |

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 | 000983 | 山西焦煤 | 3,174,601.00 | 1.48 |
| 2 | 688599 | 天合光能 | 3,046,989.47 | 1.42 |
| 3 | 601088 | 中国神华 | 2,747,172.56 | 1.28 |
| 4 | 600926 | 杭州银行 | 2,536,518.00 | 1.19 |
| 5 | 002929 | 润建股份 | 2,221,154.00 | 1.04 |
| 6 | 002271 | 东方雨虹 | 2,188,576.00 | 1.02 |
| 7 | 601009 | 南京银行 | 2,113,955.00 | 0.99 |
| 8 | 300059 | 东方财富 | 1,820,853.94 | 0.85 |
| 9 | 601899 | 紫金矿业 | 1,672,380.00 | 0.78 |
| 10 | 600782 | 新钢股份 | 1,634,073.64 | 0.76 |
| 11 | 300750 | 宁德时代 | 1,568,376.00 | 0.73 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 12 | 600938 | 中国海油 | 1,486,807.00 | 0.69 |
| 13 | 000552 | 靖远煤电 | 1,432,876.20 | 0.67 |
| 14 | 601390 | 中国中铁 | 1,351,078.00 | 0.63 |
| 15 | 603501 | 韦尔股份 | 1,189,153.00 | 0.56 |
| 16 | 603995 | 甬金股份 | 1,066,153.00 | 0.50 |
| 17 | 002036 | 联创电子 | 1,065,598.00 | 0.50 |
| 18 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,062,901.00 | 0.50 |
| 19 | 600019 | 宝钢股份 | 1,061,384.00 | 0.50 |
| 20 | 002110 | 三钢闽光 | 1,060,583.00 | 0.50 |

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 | 000983 | 山西焦煤 | 3,285,876.00 | 1.54 |
| 2 | 600926 | 杭州银行 | 2,282,866.00 | 1.07 |
| 3 | 601088 | 中国神华 | 1,763,102.00 | 0.82 |
| 4 | 000552 | 靖远煤电 | 1,450,961.60 | 0.68 |
| 5 | 600782 | 新钢股份 | 1,397,190.80 | 0.65 |
| 6 | 601155 | 新城控股 | 1,228,012.90 | 0.57 |
| 7 | 601009 | 南京银行 | 1,195,141.00 | 0.56 |
| 8 | 603501 | 韦尔股份 | 1,149,752.00 | 0.54 |
| 9 | 600029 | 南方航空 | 1,129,662.00 | 0.53 |
| 10 | 600188 | 兖矿能源 | 1,061,004.00 | 0.50 |
| 11 | 002991 | 甘源食品 | 1,011,543.00 | 0.47 |
| 12 | 600019 | 宝钢股份 | 965,443.00 | 0.45 |
| 13 | 002110 | 三钢闽光 | 916,799.00 | 0.43 |
| 14 | 600048 | 保利发展 | 908,479.00 | 0.42 |
| 15 | 600282 | 南钢股份 | 865,742.00 | 0.40 |
| 16 | 300750 | 宁德时代 | 865,451.00 | 0.40 |
| 17 | 688388 | 嘉元科技 | 848,134.34 | 0.40 |
| 18 | 688559 | 海目星 | 695,048.53 | 0.32 |
| 19 | 688599 | 天合光能 | 637,441.20 | 0.30 |
| 20 | 300059 | 东方财富 | 634,545.00 | 0.30 |

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 | 55,128,199.52 |
|---------------|---------------|

| | |
|---------------|---------------|
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 25,782,504.37 |
|---------------|---------------|

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 | 4,238,036.80 | 1.98 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 30,638,391.78 | 14.31 |
| | 其中：政策性金融债 | 30,638,391.78 | 14.31 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 97,070,533.97 | 45.35 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 19,659,730.61 | 9.19 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 151,606,693.16 | 70.83 |

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 | 160210 | 16 国开 10 | 300,000 | 30,638,391.78 | 14.31 |
| 2 | 102001478 | 20 义乌国资 MTN003 | 100,000 | 10,495,967.12 | 4.90 |
| 3 | 102001472 | 20 江北新区 MTN002 | 100,000 | 10,427,805.48 | 4.87 |
| 4 | 102102165 | 21 诚通控股 MTN006 | 100,000 | 10,343,329.86 | 4.83 |
| 5 | 102100982 | 21 大唐集 MTN001 | 100,000 | 10,099,235.62 | 4.72 |

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 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11.1 本期国债期货投资政策

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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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 | 34,588.23 |
| 2 | 应收清算款 | 509,351.94 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 543,940.17 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|---------------|
| 1 | 113052 | 兴业转债 | 2,164,194.33 | 1.01 |
| 2 | 110060 | 天路转债 | 2,162,955.40 | 1.01 |
| 3 | 128127 | 文科转债 | 1,710,244.53 | 0.80 |
| 4 | 127016 | 鲁泰转债 | 1,088,269.09 | 0.51 |

| | | | | |
|---|--------|------|--------------|------|
| 5 | 110083 | 苏租转债 | 1,072,518.05 | 0.50 |
| 6 | 123122 | 富瀚转债 | 1,068,419.24 | 0.50 |
| 7 | 128109 | 楚江转债 | 872,454.62 | 0.41 |

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 |
| 博时恒瑞一年封闭混合 A | 1,306 | 66,824.53 | 0.00 | 0.00% | 87,272,838.70 | 100.00% |
| 博时恒瑞一年封闭混合 C | 1,677 | 74,175.01 | 0.00 | 0.00% | 124,391,494.49 | 100.00% |
| 合计 | 2,945 | 71,872.44 | 0.00 | 0.00% | 211,664,333.19 | 100.00% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

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 | 博时恒瑞一年封闭混合 A | 博时恒瑞一年封闭混合 C |
|--------------------------------|---------------|----------------|
| 基金合同生效日（2022 年 2 月 24 日）基金份额总额 | 87,272,838.70 | 124,391,494.49 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | - | - |

| | | |
|-------------------------|---------------|----------------|
| 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 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 87,272,838.70 | 124,391,494.49 |

§ 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 | |
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|--------|---|---------------|--------|-----------|--------|--------|
| 国联证券 | 1 | 4,321,204.40 | 5.62% | 3,160.25 | 5.62% | 增加 1 个 |
| 招商证券 | 2 | 43,449,029.28 | 56.49% | 31,774.18 | 56.49% | 增加 2 个 |
| 海通证券 | 2 | 24,498,693.77 | 31.85% | 17,915.62 | 31.85% | - |
| 东方财富证券 | 1 | 4,643,764.60 | 6.04% | 3,396.04 | 6.04% | 增加 1 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 |
| 国联证券 | 1,071,508.84 | 1.24% | - | - | - | - |
| 招商证券 | 33,970,383.71 | 39.37% | 1,326,800,000.00 | 22.32% | - | - |
| 海通证券 | 43,155,056.86 | 50.02% | 4,616,900,000.00 | 77.68% | - | - |
| 东方财富证券 | 8,087,024.60 | 9.37% | - | - | - | - |

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旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20220430 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-04-30 |
| 2 | 博时基金管理有限公司关于调整直销网上交易定期投资业务影响部分定期投资计划的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-03-14 |
| 3 | 博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金（博时恒瑞一年封闭混合 A）基金产品资料概 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披 | 2022-02-28 |

| | 要更新 | 露网站 | |
|----|---|---------------------------|------------|
| 4 | 博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金（博时恒瑞一年封闭混合 C）基金产品资料概要更新 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-02-28 |
| 5 | 博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金合同生效公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-02-25 |
| 6 | 关于博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金延长募集时间的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-02-15 |
| 7 | 博时基金管理有限公司关于部分基金在青岛农商银行直销银行开展费率优惠活动的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-02-11 |
| 8 | 博时基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下公募基金的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-01-28 |
| 9 | 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-20220121 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-01-21 |
| 10 | 关于博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金延长募集时间的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-01-21 |
| 11 | 关于成立博时财富基金销售有限公司的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-01-20 |
| 12 | 博时基金管理有限公司关于暂停使用交通银行非快捷支付服务办理直销网上交易部分业务的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-01-06 |
| 13 | 博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通交通银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-01-04 |
| 14 | 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的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-01-01 |
| 15 | 博时基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-01-01 |

§ 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恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时恒瑞一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时恒瑞一年封闭运作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 报告期内博时恒瑞一年封闭运作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
二〇二二年八月三十一日