

博时恒元 6 个月持有期混合型证券投资 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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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 1 月 1 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 | 8 |
| 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合规守信情况的说明..... | 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..... | 9 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 10 |
| 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..... | 11 |
| 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..... | 11 |
| §5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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） | 12 |
| 6.1 资产负债表..... | 12 |
| 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..... | 17 |
| §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..... | 40 |
| 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..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 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..... | 44 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 44 |

| | |
|--|-----------|
| 7.12 投资组合报告附注..... | 44 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 45 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 45 |
| 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..... | 46 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 46 |
| 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..... | 46 |
| 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..... | 49 |
| §12 备查文件目录..... | 49 |
| 12.1 备查文件目录..... | 49 |
| 12.2 存放地点..... | 49 |
| 12.3 查阅方式..... | 49 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-----------------------|------------------|
| 基金名称 | 博时恒元 6 个月持有期混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 博时恒元 6 个月持有期混合 | |
| 基金主代码 | 011395 | |
| 交易代码 | 011395 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 3 月 16 日 | |
| 基金管理人 | 博时基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 240,050,887.29 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 博时恒元 6 个月持有期混合 A | 博时恒元 6 个月持有期混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 011395 | 011396 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 138,699,515.66 份 | 101,351,371.63 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 | 本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析互相补充的方法，在股票、债券和现金等资产类之间进行相对稳定的适度配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。本基金资产配置不仅考虑宏观基本面的影响因素同时考虑市场情绪、同业基金仓位水平的影响，并根据市场情况作出应对措施。具体的投资策略包括（1）股票投资策略，包括行业选择与配置、竞争力分析、管理层分析、财务指标分析、估值比较分析、交易策略、港股投资策略等。（2）债券投资策略，包括：期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、可转换债券投资策略等。（3）其他投资策略，包括衍生产品投资策略、资产支持证券投资策略、流通受限证券投资策略、融资业务投资策略等。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×15%+恒生综合指数收益率×5%+中债综合财富(总值)指数收益率×75%+银行活期存款利率(税后)×5%。 |
| 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 | 中国光大银行股份有限公司 |

| | | | |
|-------------|------|-----------------------------------|-------------------------------|
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 孙麒清 | 石立平 |
| | 联系电话 | 0755-83169999 | 010-63639180 |
| | 电子邮箱 | service@bosera.com | shiliping@cebbank.com |
| 客户服务电话 | | 95105568 | 95595 |
| 传真 | | 0755-83195140 | 010-63639132 |
| 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 | 北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心 |
| 办公地址 | | 广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层 | 北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心 |
| 邮政编码 | | 518040 | 100033 |
| 法定代表人 | | 江向阳 | 李晓鹏 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 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 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日） | |
|---------------|--------------------------------------|------------------|
| | 博时恒元 6 个月持有期混合 A | 博时恒元 6 个月持有期混合 C |
| 本期已实现收益 | -1,876,055.25 | -1,614,350.89 |
| 本期利润 | 1,989,807.18 | 1,214,684.07 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0122 | 0.0103 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.23% | 1.05% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.63% | 1.39% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) | |
| | 博时恒元 6 个月持有期混合 A | 博时恒元 6 个月持有期混合 C |
| 期末可供分配利润 | 256,483.89 | -464,603.24 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0018 | -0.0046 |
| 期末基金资产净值 | 140,770,315.88 | 102,200,204.08 |

| | | |
|--------------|-------------------------|------------------|
| 期末基金份额净值 | 1.0149 | 1.0084 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022年6月30日) | |
| | 博时恒元 6 个月持有期混合 A | 博时恒元 6 个月持有期混合 C |
| 基金份额累计净值增长率 | 1.49% | 0.84% |

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

博时恒元 6 个月持有期混合 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 | 2.44% | 0.37% | 1.57% | 0.22% | 0.87% | 0.15% |
| 过去三个月 | 3.38% | 0.27% | 2.09% | 0.28% | 1.29% | -0.01% |
| 过去六个月 | 1.63% | 0.24% | -0.06% | 0.31% | 1.69% | -0.07% |
| 过去一年 | 1.19% | 0.29% | 0.21% | 0.26% | 0.98% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.49% | 0.26% | 2.00% | 0.25% | -0.51% | 0.01% |

博时恒元 6 个月持有期混合 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 | 2.41% | 0.37% | 1.57% | 0.22% | 0.84% | 0.15% |
| 过去三个月 | 3.26% | 0.27% | 2.09% | 0.28% | 1.17% | -0.01% |
| 过去六个月 | 1.39% | 0.24% | -0.06% | 0.31% | 1.45% | -0.07% |
| 过去一年 | 0.69% | 0.29% | 0.21% | 0.26% | 0.48% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.84% | 0.26% | 2.00% | 0.25% | -1.16% | 0.01% |

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×15%+恒生综合指数收益率×5%+中债综合财富(总值)指数收益率×75%+银行活期存款利率(税后)×5%。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 15%、5%、75%、5%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。

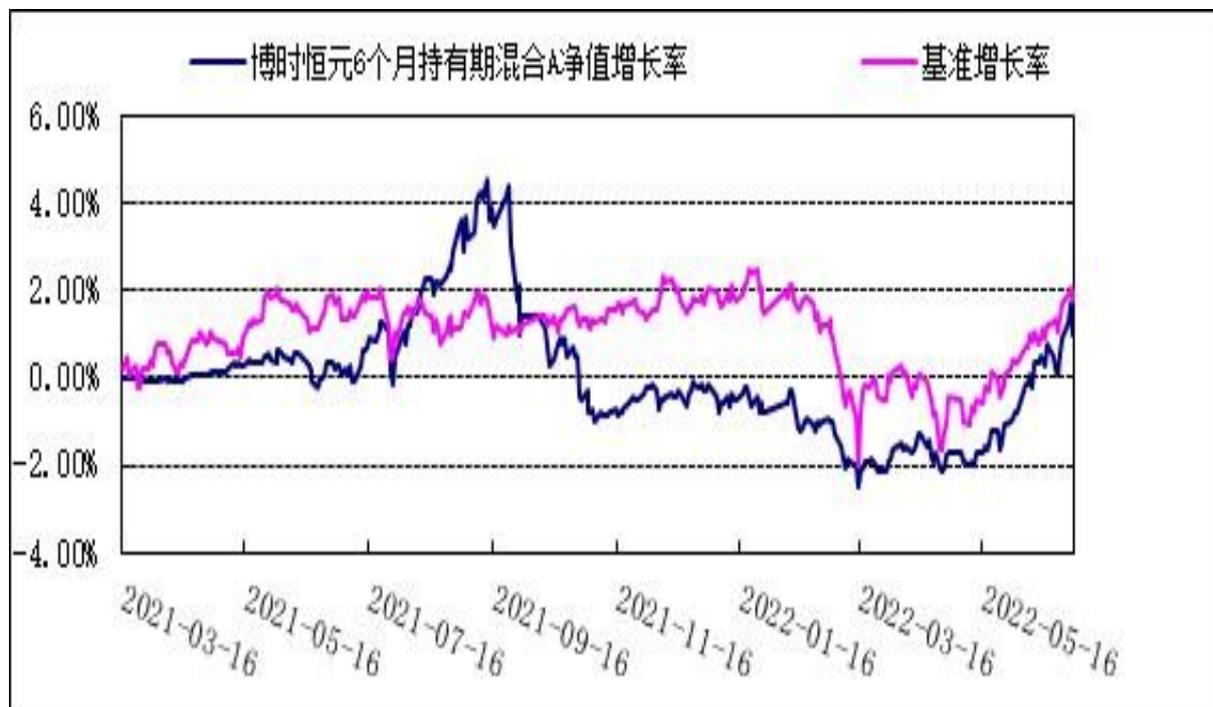
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时恒元 6 个月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 3 月 16 日至 2022 年 6 月 30 日)

博时恒元 6 个月持有期混合 A



博时恒元 6 个月持有期混合 C



注：本基金的基金合同于 2021 年 3 月 16 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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 | | |
| 卓若伟 | 基金经理 | 2021-03-16 | - | 15.7 | 卓若伟先生，硕士。2004 年起先后在厦门市商业银行、建信基金、诺安基金、泰达宏利基金、深圳市鹏城基石投资管理有限公司工作。2017 年加入博时基金管理有限公司。历任投资经理、绝对收益投资部投资副总监。现任博时恒盛一年持有期混合型证券投资基金(2020 年 7 月 31 日一至今)、博时恒利 6 个月持有期债券型证券投资基金(2020 年 9 月 24 日一至今)、博时恒荣一年持有期混合型证券投资基金(2020 年 9 月 27 日一至今)、博时恒元 6 个月持有期混合型证券投资基金(2021 年 3 月 16 日一至今)、博时乐享混合型证券投资基金(2021 年 5 月 28 日一至今)、博时恒润 6 个月持有期混合型证券投资基金(2021 年 10 月 26 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

报告期内，出乎意料的黑天鹅事件冲击 A 股市场，股市先抑后扬大幅震荡，首先，2 月以来俄乌冲突持续恶化，既把全球脆弱的经济进一步推向滞胀泥潭，也卷起了新一轮逆全球化思潮，中美关系趋于紧张。其次，国内疫情多点频发，多城相继按下暂停键，“三重压力”雪上加霜，让市场怀疑稳增长的功效。国内受疫情反复影响扰动总需求和供应链，疫情防控总体向好但任务艰巨，为应对国内经济面临的多重压力，政府发布多项经济建设行动纲领，对于小微企业纾困、扩内需、促销费、加大退税力度、加快专项债使用等作出重要部署，4 月降准，5 月降息，释放重要政策信号，增强市场信心，6 月开始经济进入快速恢复通道。二季度股市先抑后扬，探底后持续大幅反弹两个月，期间偶尔出现数次回调，但都很快得到修复，热门行业短期反弹较多，下一阶段资本市场保持稳中求进的概率较大。政策面因素会促使风险偏好的修复，社融信贷有进一步改善预期，防疫政策边际调整，也会给服务业和消费带来催化。

海外市场方面，受能源等价格上升至历史高位影响，美国通胀连续创新高，推动美联储连续加息，为二十多年来最大加息幅度，并且有可能在三季度继续类似幅度加息。受此影响外围股市震荡下行表现疲弱。

报告期内，我们抓住机会积极参与权益市场反弹行情，从前期的成长周期均衡配置，逐渐向科技成长赛道倾斜，以持续向好的汽车、新能源等为代表的长景气、先进制造业为主，市场强势超出不少投资者预期，因此基金业绩得到一定幅度回升。

债券市场方面，央行陆续采取下调 MLF、逆回购利率、LPR 和贷款利率，4 月下调准备金率，坚定执行宽货币政策，受美联储大幅加息和缩表收紧流动性，投资者对经济复苏前景有所减弱，债券收益率窄幅震荡整体保持下行趋势。转债市场方面，年初估值溢价率水平较高，但整体跟随股市先跌后反弹的走势，在反弹过程中，前期压缩的估值再次被逐渐抬升。

报告期内，我们积极配置期限适中的信用债和利率债，维持适度的债券仓位和杠杆，以信用水平较优的信用债为主，注重防范信用风险，获取了较为稳健的票息收益。在可转债方面，维持中等偏低的转债仓位，以稳健的偏债型可转债为主，适度参与转债波段交易增强组合业绩。

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 1.0149 元，份额累计净值为 1.0149 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0084 元，份额累计净值为 1.0084 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 1.63%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 1.39%，同期业绩基准增长率为-0.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为国内经济将步入企稳回升阶段，一方面国内政策刺激效果将逐渐反应，同时疫情对产业链的冲击将逐渐减弱；另一方面，海外滞涨影响逐渐显现，部分海外需求受到挤压大宗商品价格压力趋于缓解，对国内制造业的成本压力也有降低，预计下半年整体企业盈利将呈现环比改善，在 2 季度疫情冲击偏低位置下企稳回升，但考虑当前全球经济中通胀对总需求的挤压，预计整体回升幅度会相对有限。对市场而言，我们认为权益的相对吸引力仍处于中高区间，国内居民增量财富加配权益的趋势以及海外资金增配中国资产的趋势均没发生变化，整体市场在下半年预计会迎来结构性机会。

从产业层面，我们看到中国的产业竞争力在全球持续提升，主要从三个维度体现。一、对于新兴的制造业机会，如动力电池、光伏、无人机等，都在国内得到较好的发展，并且头部公司在全球市场具备明显竞争优势。二、对于传统的高附加值领域，比如通信、电子、汽车、创新药、核心元器件等方向，国内的头部公司也在较快缩小与海外同行的差距，在国内外逐步扩张市场份额。三、

对于部分劳动密集型传统产业，国内头部企业通过智能化改造、产业链的跨国分布，仍然保持较强的掌控力，并持续提升盈利能力。基于此，我们继续看好权益市场的表现，对于部分优质的头部企业而言，经营价值的增长仍将驱动股价的表现。对于下半年而言，部分制造方向中需求强劲环节叠加成本的下降，可能会迎来盈利和股价的向上弹性，接下来我们将继续不断寻找和配置基本面向好的行业和个股。

展望下一阶段经济总体稳中向好，流动性维持合理充裕，关注宽货币、宽信用落地效果，在债牛未尽的背景下，我们将积极配置信用资质优、期限适中的固定收益资产，继续适度参与偏稳健的可转债投资机会。

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，中国光大银行股份有限公司在博时恒元 6 个月持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《博时恒元 6 个月持有期混合型证券投资基金 2022 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 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：博时恒元 6 个月持有期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 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.4.1 | 13,784,762.24 | 4,686,226.65 |
| 结算备付金 | | 5,639,519.88 | 5,002,372.68 |
| 存出保证金 | | 29,591.94 | 132,919.83 |
| 交易性金融资产 | 6.4.4.2 | 223,915,894.43 | 312,396,922.12 |
| 其中：股票投资 | | 44,853,924.60 | 16,072,009.62 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 179,061,969.83 | 296,324,912.50 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.4.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.4.4 | 19,500,000.00 | 10,900,000.00 |
| 应收清算款 | | 240,929.83 | 1,413,971.83 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.4.5 | - | 2,769,597.52 |
| 资产总计 | | 263,110,698.32 | 337,302,010.63 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.4.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 5,001,375.32 | 21,800,000.00 |
| 应付清算款 | | 8,707,200.70 | - |
| 应付赎回款 | | 5,964,762.65 | 1,139,698.63 |
| 应付管理人报酬 | | 169,139.35 | 219,329.56 |
| 应付托管费 | | 42,284.84 | 54,832.41 |
| 应付销售服务费 | | 44,524.87 | 57,057.38 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 3,897.75 | 9,072.17 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.4.6 | 206,992.88 | 124,896.45 |
| 负债合计 | | 20,140,178.36 | 23,404,886.60 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.4.7 | 240,050,887.29 | 314,862,054.43 |
| 其他综合收益 | | - | - |

| | | | |
|-----------------|---------|-----------------------|-----------------------|
| 未分配利润 | 6.4.4.8 | 2,919,632.67 | -964,930.40 |
| 净资产合计 | | 242,970,519.96 | 313,897,124.03 |
| 负债和净资产总计 | | 263,110,698.32 | 337,302,010.63 |

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 240,050,887.29 份。其中 A 类基金份额净值 1.0149 元，基金份额 138,699,515.66 份；C 类基金份额净值 1.0084 元，基金份额 101,351,371.63 份。

6.2 利润表

会计主体：博时恒元 6 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 3 月 16 日（基 金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 5,004,955.95 | 5,216,975.66 |
| 1. 利息收入 | | 318,961.70 | 5,670,070.50 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.4.9 | 51,505.17 | 423,617.98 |
| 债券利息收入 | | - | 4,628,986.22 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 267,456.53 | 617,466.30 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -2,008,903.14 | -927,250.00 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.4.10 | -3,473,247.93 | -1,083,003.40 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.4.11 | 1,190,303.29 | -357,981.03 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.4.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.4.13 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.4.14 | 274,041.50 | 513,734.43 |
| 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） | 6.4.4.15 | 6,694,897.39 | 474,155.16 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.4.16 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 1,800,464.70 | 3,440,456.59 |
| 1. 管理人报酬 | | 1,104,212.05 | 1,822,106.14 |
| 2. 托管费 | | 276,053.00 | 455,526.54 |
| 3. 销售服务费 | | 287,922.19 | 534,320.21 |

| | | | |
|----------------------------|----------|---------------------|---------------------|
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 27,853.95 | 293,215.10 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 27,853.95 | 293,215.10 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.4.17 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 4,150.65 | 9,089.85 |
| 8. 其他费用 | 6.4.4.18 | 100,272.86 | 326,198.75 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 3,204,491.25 | 1,776,519.07 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 3,204,491.25 | 1,776,519.07 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 3,204,491.25 | 1,776,519.07 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时恒元 6 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1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） | 314,862,054.43 | - | -964,930.40 | 313,897,124.03 |
| 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） | 314,862,054.43 | - | -964,930.40 | 313,897,124.03 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -74,811,167.14 | - | 3,884,563.07 | -70,926,604.07 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 3,204,491.25 | 3,204,491.25 |
| （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） | -74,811,167.14 | - | 680,071.82 | -74,131,095.32 |
| 其中：1. 基金申购款 | 273,958.24 | - | -718.85 | 273,239.39 |
| 2. 基金赎回款 | -75,085,125.38 | - | 680,790.67 | -74,404,334.71 |
| （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） | 240,050,887.29 | - | 2,919,632.67 | 242,970,519.96 |
| 项目 | 上年度可比期间 2021年3月16日（基金合同生效日）至2021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） | 783,179,101.40 | - | - | 783,179,101.40 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 64,022.50 | - | 1,776,340.60 | 1,840,363.10 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 1,776,519.07 | 1,776,519.07 |
| （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） | 64,022.50 | - | -178.47 | 63,844.03 |
| 其中：1. 基金申购款 | 64,022.50 | - | -178.47 | 63,844.03 |
| 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） | 783,243,123.90 | - | 1,776,340.60 | 785,019,464.50 |

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.1.1 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。

6.4.1.2 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。

6.4.1.3 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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融

资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,686,226.65 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,822.06 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,688,048.71 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,002,372.68 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,476.21 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,004,848.89 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 132,919.83 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 65.78 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 132,985.61 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,769,597.52 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 1,822.06 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 2,476.21 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 65.78 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 2,765,233.47 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 312,396,922.12 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,765,233.47 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 315,162,155.59 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 21,800,000.00 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 10,880.51 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 21,810,880.51 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,880.51 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 10,880.51 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.2.3 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。

6.4.3 税项

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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。

6.4.3.3 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。

6.4.3.4 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。

6.4.3.5 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。

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 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 | 13,784,762.24 |
| 等于：本金 | 13,783,621.35 |
| 加：应计利息 | 1,140.89 |
| 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 | 13,784,762.24 |

6.4.4.2 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 | | 37,475,420.19 | - | 44,853,924.60 | 7,378,504.41 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 71,899,376.78 | 321,536.66 | 72,868,761.16 | 647,847.72 |
| | 银行间市场 | 104,280,694.24 | 1,423,708.67 | 106,193,208.67 | 488,805.76 |
| | 合计 | 176,180,071.02 | 1,745,245.33 | 179,061,969.83 | 1,136,653.48 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 213,655,491.21 | 1,745,245.33 | 223,915,894.43 | 8,515,157.89 |

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

6.4.4.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.4.4 买入返售金融资产

6.4.4.4.1 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 | 19,500,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 19,500,000.00 | - |

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.4.5 其他资产

无余额。

6.4.4.6 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 | 70,870.02 |
| 其中：交易所市场 | 69,195.02 |
| 银行间市场 | 1,675.00 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 136,122.86 |
| 合计 | 206,992.88 |

6.4.4.7 实收基金

博时恒元 6 个月持有期混合 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 183,286,051.28 | 183,286,051.28 |
| 本期申购 | 164,663.63 | 164,663.63 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -44,751,199.25 | -44,751,199.25 |
| 本期末 | 138,699,515.66 | 138,699,515.66 |

博时恒元 6 个月持有期混合 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 131,576,003.15 | 131,576,003.15 |
| 本期申购 | 109,294.61 | 109,294.61 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -30,333,926.13 | -30,333,926.13 |
| 本期末 | 101,351,371.63 | 101,351,371.63 |

注：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)。

6.4.4.8 未分配利润

博时恒元 6 个月持有期混合 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 |
|----------------|---------------|---------------|--------------|
| 上年度末 | 2,373,828.37 | -2,630,745.40 | -256,917.03 |
| 本期利润 | -1,876,055.25 | 3,865,862.43 | 1,989,807.18 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -241,289.23 | 579,199.30 | 337,910.07 |
| 其中：基金申购款 | 752.93 | 377.92 | 1,130.85 |
| 基金赎回款 | -242,042.16 | 578,821.38 | 336,779.22 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 256,483.89 | 1,814,316.33 | 2,070,800.22 |

博时恒元 6 个月持有期混合 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 |
|----------------|---------------|---------------|--------------|
| 上年度末 | 1,172,675.67 | -1,880,689.04 | -708,013.37 |
| 本期利润 | -1,614,350.89 | 2,829,034.96 | 1,214,684.07 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -22,928.02 | 365,089.77 | 342,161.75 |
| 其中：基金申购款 | 719.65 | -2,569.35 | -1,849.70 |
| 基金赎回款 | -23,647.67 | 367,659.12 | 344,011.45 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -464,603.24 | 1,313,435.69 | 848,832.45 |

6.4.4.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 26,328.33 |
| 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 | 24,631.33 |
| 其他 | 545.51 |
| 合计 | 51,505.17 |

6.4.4.10 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 45,768,087.74 |
| 减：卖出股票成本总额 | 49,102,911.38 |
| 减：交易费用 | 138,424.29 |
| 买卖股票差价收入 | -3,473,247.93 |

6.4.4.11 债券投资收益

6.4.4.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 2,673,661.94 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -1,483,358.65 |
| 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 | 1,190,303.29 |

6.4.4.11.2 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1月1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 | 253,682,575.35 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 252,613,963.49 |
| 减：应计利息总额 | 2,546,447.69 |
| 减：交易费用 | 5,522.82 |
| 买卖债券差价收入 | -1,483,358.65 |

6.4.4.12 资产支持证券投资收益
6.4.4.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.4.12.2 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。

6.4.4.13 衍生工具收益
6.4.4.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.4.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

6.4.4.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 274,041.50 |
| 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 | 274,041.50 |

6.4.4.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 6,694,897.39 |
| ——股票投资 | 7,096,385.96 |
| ——债券投资 | -401,488.57 |
| ——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 | 6,694,897.39 |

6.4.4.16 其他收入

无发生额。

6.4.4.17 信用减值损失

无。

6.4.4.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 审计费用 | 22,315.49 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 中债登账户维护费 | 9,000.00 |
| 上清所账户维护费 | 9,450.00 |
| 合计 | 100,272.86 |

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.5.2 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。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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 |
| 中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”） | 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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2021 年 3 月 16 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 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 招商证券 | 109,695,945.62 | 96.24% | 153,335,828.51 | 63.29% |

6.4.7.1.2 权证交易

无。

6.4.7.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2021 年 3 月 16 日(基金合同生效日) 至 2021 年 6 月 30 日 | |
|-------|---------------------------------------|--------------|--|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 招商证券 | 157,216,051.07 | 94.21% | 177,981,415.29 | 23.13% |

6.4.7.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2021 年 3 月 16 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 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 招商证券 | 2,889,619,000.00 | 88.98% | 1,016,700,000.00 | 22.18% |

6.4.7.1.5 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 1 月 1 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 | 80,221.74 | 96.24% | 69,195.02 | 100.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 | | | |
| | 2021 年 3 月 16 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 | 112,128.45 | 63.29% | 112,128.45 | 68.26% |

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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 3 月 16 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 | 1,104,212.05 | 1,822,106.14 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 547,799.04 | 907,280.68 |

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 3 月 16 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 | 276,053.00 | 455,526.54 |

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.7.2.3 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 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|--------------------|---------------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |

| | 博时恒元 6 个月持有期混合 A | 博时恒元 6 个月持有期混合 C | 合计 |
|----------------|--|------------------|------------|
| 光大银行 | - | 286,299.51 | 286,299.51 |
| 博时基金 | - | 71.56 | 71.56 |
| 合计 | - | 286,371.07 | 286,371.07 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2021 年 3 月 16 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 | | |
| | 博时恒元 6 个月持有期混合 A | 博时恒元 6 个月持有期混合 C | 合计 |
| 光大银行 | - | 532,764.77 | 532,764.77 |
| 博时基金 | - | 50.90 | 50.90 |
| 合计 | - | 532,815.67 | 532,815.67 |

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 0.50% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.7.4 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

6.4.7.4.1 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。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

6.4.7.5.2 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。

6.4.7.6 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 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2021 年 3 月 16 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 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| | | | | |

| | | | | |
|-------------|---------------|-----------|--------------|-----------|
| 中国光大银行-活期存款 | 13,784,762.24 | 26,328.33 | 4,689,258.56 | 90,522.55 |
|-------------|---------------|-----------|--------------|-----------|

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。

6.4.7.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.7.8 其他关联交易事项的说明

6.4.7.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 利润分配情况

无。

6.4.9 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告 2022 年 06 月 30 日，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 5,001,375.32 元，于 2022 年 07 月 01 日（先后到期）。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.9.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 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，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。

6.4.10.2 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。

6.4.10.2.1 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 | 上年末 2021 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|-------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 17,188,740.00 | 85,062,000.00 |
| 合计 | 17,188,740.00 | 85,062,000.00 |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.10.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.10.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2022年6月30日 | 上年末 2021年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 39,627,702.09 | 38,976,000.00 |
| 合计 | 39,627,702.09 | 38,976,000.00 |

6.4.10.2.4 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 | 上年末 2021 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|-------------------------|
| AAA | 49,929,795.58 | 70,237,579.60 |
| AAA 以下 | 5,864,607.77 | 24,999,240.20 |
| 未评级 | 66,451,124.39 | 77,050,092.70 |
| 合计 | 122,245,527.74 | 172,286,912.50 |

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。

6.4.10.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.10.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.10.3 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。

6.4.10.3.1 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时间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。

6.4.10.4 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。

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.1.1 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 | 13,784,762.24 | - | - | - | 13,784,762.24 |
| 结算备付金 | 5,639,519.88 | - | - | - | 5,639,519.88 |
| 存出保证金 | 29,591.94 | - | - | - | 29,591.94 |
| 交易性金融资产 | 71,958,066.75 | 95,399,243.93 | 11,704,659.15 | 44,853,924.60 | 223,915,894.43 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 240,929.83 | 240,929.83 |
| 买入返售金融资产 | 19,500,000.00 | - | - | - | 19,500,000.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 110,911,940.81 | 95,399,243.93 | 11,704,659.15 | 45,094,854.43 | 263,110,698.32 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 5,001,375.32 | - | - | - | 5,001,375.32 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 5,964,762.65 | 5,964,762.65 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 8,707,200.70 | 8,707,200.70 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 169,139.35 | 169,139.35 |
| 应付托管费 | - | - | - | 42,284.84 | 42,284.84 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 44,524.87 | 44,524.87 |
| 应交税费 | - | - | - | 3,897.75 | 3,897.75 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 206,992.88 | 206,992.88 |
| 负债总计 | 5,001,375.32 | - | - | 15,138,803.04 | 20,140,178.36 |
| 利率敏感度缺口 | 105,910,565.49 | 95,399,243.93 | 11,704,659.15 | 29,956,051.39 | 242,970,519.96 |
| 上年度末 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |

| | | | | | |
|------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|
| 2021 年 12 月 31 日 | | | | | |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 4,686,226.65 | - | - | - | 4,686,226.65 |
| 结算备付金 | 5,002,372.68 | - | - | - | 5,002,372.68 |
| 存出保证金 | 132,919.83 | - | - | - | 132,919.83 |
| 交易性金融资产 | 124,038,000.00 | 142,692,122.40 | 29,594,790.10 | 16,072,009.62 | 312,396,922.12 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 1,413,971.83 | 1,413,971.83 |
| 买入返售金融资产 | 10,900,000.00 | - | - | - | 10,900,000.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | 2,769,597.52 | 2,769,597.52 |
| 资产总计 | 144,759,519.16 | 142,692,122.40 | 29,594,790.10 | 20,255,578.97 | 337,302,010.63 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 21,800,000.00 | - | - | - | 21,800,000.00 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,139,698.63 | 1,139,698.63 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 219,329.56 | 219,329.56 |
| 应付托管费 | - | - | - | 54,832.41 | 54,832.41 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 57,057.38 | 57,057.38 |
| 应交税费 | - | - | - | 9,072.17 | 9,072.17 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 124,896.45 | 124,896.45 |
| 负债总计 | 21,800,000.00 | - | - | 1,604,886.60 | 23,404,886.60 |
| 利率敏感度缺口 | 122,959,519.16 | 142,692,122.40 | 29,594,790.10 | 18,650,692.37 | 313,897,124.03 |

注：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。

6.4.10.4.1.2 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 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | 减少约 40 | 减少约 91 |
| 市场利率下降 25 个基点 | 增加约 41 | 增加约 93 | |

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.4.3 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。

6.4.10.4.3.1 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 | | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 | |
|---------------|------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产 净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产 净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 44,853,924.60 | 18.46 | 16,072,009.62 | 5.12 |
| 交易性金融资产—债券投资 | 40,504,728.83 | 16.67 | 60,004,319.80 | 19.12 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 合计 | 85,358,653.43 | 35.13 | 76,076,329.42 | 24.24 |

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。

6.4.10.4.3.2 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 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| | 业绩比较基准上升 5% | 增加约 448 | 增加约 208 |
| | 业绩比较基准下降 5% | 减少约 448 | 减少约 208 |

6.4.11 公允价值

6.4.11.1 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。

6.4.11.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.11.2.1 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 | 85,358,653.43 |
| 第二层次 | 138,557,241.00 |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 223,915,894.43 |

6.4.11.2.2 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。

6.4.11.3 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（上年度末：同）。

6.4.11.4 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。

6.4.12 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

资产负债表的以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

利润表的以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比

期间”金额。

§ 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 | 44,853,924.60 | 17.05 |
| | 其中：股票 | 44,853,924.60 | 17.05 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 179,061,969.83 | 68.06 |
| | 其中：债券 | 179,061,969.83 | 68.06 |
| | 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 | 19,500,000.00 | 7.41 |
| | 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 | 19,424,282.12 | 7.38 |
| 8 | 其他各项资产 | 270,521.77 | 0.10 |
| 9 | 合计 | 263,110,698.32 | 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 | 10,532,684.00 | 4.33 |
| C | 制造业 | 33,582,100.60 | 13.82 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 739,140.00 | 0.30 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| 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 | 44,853,924.60 | 18.46 |

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 | 600438 | 通威股份 | 69,100 | 4,136,326.00 | 1.70 |
| 2 | 000887 | 中鼎股份 | 215,200 | 3,925,248.00 | 1.62 |
| 3 | 600993 | 马应龙 | 141,600 | 3,299,280.00 | 1.36 |
| 4 | 601615 | 明阳智能 | 84,700 | 2,862,860.00 | 1.18 |
| 5 | 002460 | 赣锋锂业 | 17,300 | 2,572,510.00 | 1.06 |
| 6 | 601001 | 晋控煤业 | 140,500 | 2,493,875.00 | 1.03 |
| 7 | 601012 | 隆基绿能 | 37,100 | 2,471,973.00 | 1.02 |
| 8 | 603619 | 中曼石油 | 115,300 | 2,371,721.00 | 0.98 |
| 9 | 300394 | 天孚通信 | 75,200 | 2,035,664.00 | 0.84 |
| 10 | 300502 | 新易盛 | 74,400 | 1,949,280.00 | 0.80 |
| 11 | 603596 | 伯特利 | 23,600 | 1,892,248.00 | 0.78 |
| 12 | 605123 | 派克新材 | 12,500 | 1,759,000.00 | 0.72 |
| 13 | 600188 | 兖矿能源 | 43,800 | 1,729,224.00 | 0.71 |
| 14 | 000983 | 山西焦煤 | 105,900 | 1,418,001.00 | 0.58 |
| 15 | 600938 | 中国海油 | 68,300 | 1,191,835.00 | 0.49 |
| 16 | 688187 | 时代电气 | 16,200 | 1,052,838.00 | 0.43 |
| 17 | 300073 | 当升科技 | 9,400 | 849,196.00 | 0.35 |
| 18 | 300014 | 亿纬锂能 | 8,700 | 848,250.00 | 0.35 |
| 19 | 000818 | 航锦科技 | 22,200 | 752,580.00 | 0.31 |
| 20 | 300059 | 东方财富 | 29,100 | 739,140.00 | 0.30 |
| 21 | 603799 | 华友钴业 | 7,280 | 696,113.60 | 0.29 |
| 22 | 601088 | 中国神华 | 20,100 | 669,330.00 | 0.28 |
| 23 | 601225 | 陕西煤业 | 31,100 | 658,698.00 | 0.27 |
| 24 | 600702 | 舍得酒业 | 2,500 | 509,975.00 | 0.21 |
| 25 | 002906 | 华阳集团 | 10,100 | 457,631.00 | 0.19 |
| 26 | 603960 | 克来机电 | 21,500 | 441,825.00 | 0.18 |
| 27 | 600129 | 太极集团 | 12,900 | 283,413.00 | 0.12 |
| 28 | 600460 | 士兰微 | 5,300 | 275,600.00 | 0.11 |
| 29 | 600809 | 山西汾酒 | 800 | 259,840.00 | 0.11 |
| 30 | 002812 | 恩捷股份 | 1,000 | 250,450.00 | 0.10 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1 | 000887 | 中鼎股份 | 4,352,147.02 | 1.39 |
| 2 | 000002 | 万科 A | 4,220,001.00 | 1.34 |
| 3 | 600993 | 马应龙 | 3,321,917.68 | 1.06 |
| 4 | 600438 | 通威股份 | 3,230,484.00 | 1.03 |
| 5 | 601088 | 中国神华 | 2,474,015.00 | 0.79 |
| 6 | 601615 | 明阳智能 | 2,370,190.00 | 0.76 |
| 7 | 300502 | 新易盛 | 2,351,254.74 | 0.75 |
| 8 | 002460 | 赣锋锂业 | 2,328,001.00 | 0.74 |
| 9 | 300394 | 天孚通信 | 2,133,550.00 | 0.68 |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 2,065,986.80 | 0.66 |
| 11 | 600048 | 保利发展 | 2,040,179.00 | 0.65 |
| 12 | 601919 | 中远海控 | 2,014,386.00 | 0.64 |
| 13 | 600741 | 华域汽车 | 1,987,616.00 | 0.63 |
| 14 | 601001 | 晋控煤业 | 1,981,614.00 | 0.63 |
| 15 | 600188 | 兖矿能源 | 1,976,925.00 | 0.63 |
| 16 | 601012 | 隆基绿能 | 1,953,622.00 | 0.62 |
| 17 | 000933 | 神火股份 | 1,914,505.00 | 0.61 |
| 18 | 603596 | 伯特利 | 1,752,232.00 | 0.56 |
| 19 | 600460 | 士兰微 | 1,662,777.99 | 0.53 |
| 20 | 601398 | 工商银行 | 1,445,280.00 | 0.46 |

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1 | 300059 | 东方财富 | 3,823,491.40 | 1.22 |
| 2 | 000002 | 万科 A | 3,812,648.00 | 1.21 |
| 3 | 600810 | 神马股份 | 2,649,703.00 | 0.84 |
| 4 | 600741 | 华域汽车 | 2,181,915.00 | 0.70 |
| 5 | 000933 | 神火股份 | 2,035,155.00 | 0.65 |
| 6 | 601088 | 中国神华 | 2,017,597.00 | 0.64 |
| 7 | 600563 | 法拉电子 | 1,966,952.00 | 0.63 |
| 8 | 601919 | 中远海控 | 1,918,771.00 | 0.61 |
| 9 | 600048 | 保利发展 | 1,726,195.00 | 0.55 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 10 | 601398 | 工商银行 | 1,443,402.00 | 0.46 |
| 11 | 600460 | 士兰微 | 1,421,159.00 | 0.45 |
| 12 | 000887 | 中鼎股份 | 1,201,689.58 | 0.38 |
| 13 | 600153 | 建发股份 | 1,170,310.00 | 0.37 |
| 14 | 600019 | 宝钢股份 | 1,085,600.00 | 0.35 |
| 15 | 600309 | 万华化学 | 1,031,257.00 | 0.33 |
| 16 | 601939 | 建设银行 | 996,600.00 | 0.32 |
| 17 | 688187 | 时代电气 | 879,990.98 | 0.28 |
| 18 | 000661 | 长春高新 | 856,338.00 | 0.27 |
| 19 | 600690 | 海尔智家 | 798,603.00 | 0.25 |
| 20 | 002459 | 晶澳科技 | 783,628.16 | 0.25 |

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 | 70,788,440.40 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 45,768,087.74 |

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 | 22,168,652.33 | 9.12 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 41,030,561.65 | 16.89 |
| | 其中：政策性金融债 | 41,030,561.65 | 16.89 |
| 4 | 企业债券 | 10,195,380.00 | 4.20 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 25,534,944.93 | 10.51 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 40,504,728.83 | 16.67 |
| 8 | 同业存单 | 39,627,702.09 | 16.31 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 179,061,969.83 | 73.70 |

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 | 190203 | 19 国开 03 | 300,000 | 30,868,849.32 | 12.70 |

| | | | | | |
|---|-----------|---------------|---------|---------------|------|
| 2 | 112103113 | 21 农业银行 CD113 | 200,000 | 19,950,800.99 | 8.21 |
| 3 | 112209076 | 22 浦发银行 CD076 | 200,000 | 19,676,901.10 | 8.10 |
| 4 | 019629 | 20 国债 03 | 150,000 | 15,141,624.66 | 6.23 |
| 5 | 113042 | 上银转债 | 103,840 | 10,911,017.87 | 4.49 |

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。上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会、国家外汇管理局上海市分局、中国人民银行福州中心支行的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会甘肃监管局、中国银行保险监督管理委员会福建监管局、中国人民银行崇左市中心支行、中国人民银行太原中心支行的处罚。上海银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。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 | 29,591.94 |
| 2 | 应收清算款 | 240,929.83 |
| 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 | 270,521.77 |

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 | 113042 | 上银转债 | 10,911,017.87 | 4.49 |
| 2 | 110059 | 浦发转债 | 7,063,757.84 | 2.91 |
| 3 | 113044 | 大秦转债 | 5,229,335.04 | 2.15 |
| 4 | 110079 | 杭银转债 | 1,295,420.13 | 0.53 |
| 5 | 110053 | 苏银转债 | 1,211,922.59 | 0.50 |
| 6 | 110083 | 苏租转债 | 819,520.00 | 0.34 |
| 7 | 113626 | 伯特转债 | 570,091.65 | 0.23 |
| 8 | 110067 | 华安转债 | 277,593.05 | 0.11 |

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 |
|----------------------|-------|-----------|------|------------|----------------|------------|
| 博时恒元 6 个月 持有期混合 A | 1,803 | 76,927.07 | 0.00 | 0.00% | 138,699,515.66 | 100.00% |
| 博时恒元 6 个月 持有期混合 C | 1,024 | 98,975.95 | 0.00 | 0.00% | 101,351,371.63 | 100.00% |
| 合计 | 2,800 | 85,732.46 | 0.00 | 0.00% | 240,050,887.29 | 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 | 博时恒元 6 个月持有期混合 A | 博时恒元 6 个月持有期混合 C |
|--------------------------------|------------------|---------------------|
| 基金合同生效日（2021 年 3 月 16 日）基金份额总额 | 415,581,229.89 | 367,597,871.51 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 183,286,051.28 | 131,576,003.15 |
| 本报告期基金总申购份额 | 164,663.63 | 109,294.61 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 44,751,199.25 | 30,333,926.13 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 138,699,515.66 | 101,351,371.63 |

§ 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，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

本报告期内，基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中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 | |
| 中泰证券 | 1 | 4,288,748.10 | 3.76% | 3,136.25 | 3.76% | - |
| 招商证券 | 2 | 109,695,945.62 | 96.24% | 80,221.74 | 96.24% | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |

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，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 |
| 中泰证券 | 9,658,875.00 | 5.79% | 357,700,000.00 | 11.02% | - | - |
| 招商证券 | 157,216,051.07 | 94.21% | 2,889,619,000.00 | 88.98% | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-04-30 |
| 2 | 博时恒元 6 个月持有期混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-04-22 |
| 3 | 博时恒元 6 个月持有期混合型证券投资基金 2021 年年度报告 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-03-30 |
| 4 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-03-14 |
| 5 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-02-11 |
| 6 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-01-28 |
| 7 | 博时恒元 6 个月持有期混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-01-24 |
| 8 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-01-21 |
| 9 | 关于成立博时财富基金销售有限公司的公告 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-01-20 |
| 10 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-01-06 |
| 11 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-01-04 |
| 12 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2022-01-01 |
| 13 | 博时基金管理有限公司关于旗下公开募集证 | 中国证券报、基金管理人网 | 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元 6 个月持有期混合型证券投资基金设立的文件

12.1.2 《博时恒元 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》

12.1.3 《博时恒元 6 个月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 博时恒元 6 个月持有期混合型证券投资基金各年度审计报告正本

12.1.6 报告期内博时恒元 6 个月持有期混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

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）

二〇二二年八月三十一日