

**博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金**  
**2022 年第 4 季度报告**  
**2022 年 12 月 31 日**

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年一月二十日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 博时鑫润混合   |
| 基金主代码      | 003950   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2016 年 12 月 7 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 169,508,756.26 份   |
| 投资目标       | 本基金通过对多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期持续稳定的投资回报。   |
| 投资策略       | 本基金的投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、其他资产投资策略三个部分。其中，资产配置策略主要是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。股票投资以定性和定量分析为基础，从基本面分析入手，根据对市场趋势的判断、宏观经济环境等因素，对成长与价值股的投资比例进行配置。总体而言，成长股与价值股在股票资产中进行相对均衡的配置，适度调整。以控制因风格带来的投资风险，降低组合波动的风险，提高整体收益率。其他资产投资策略有债券投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、存托凭证投资策略，其中，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。 |
| 业绩比较基准     | 沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%  |

|                 |  |                  |
|-----------------|--|------------------|
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。 |                  |
| 基金管理人           | 博时基金管理有限公司   |                  |
| 基金托管人           | 上海浦东发展银行股份有限公司   |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 博时鑫润混合 A   | 博时鑫润混合 C         |
| 下属分级基金的交易代码     | 003950   | 003951           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 653,272.33 份   | 168,855,483.93 份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期<br>(2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日) |                |
|-----------------|---|----------------|
|                 | 博时鑫润混合 A                                  | 博时鑫润混合 C       |
| 1. 本期已实现收益      | 3,442.79                                  | 789,738.16     |
| 2. 本期利润         | -5,950.32                                 | -565,993.04    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0087                                   | -0.0034        |
| 4. 期末基金资产净值     | 841,081.48                                | 216,854,793.22 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.2875                                    | 1.2843         |

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（不包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。

所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

###### 1. 博时鑫润混合A:

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -0.23%     | 0.50%         | 0.98%          | 0.64%                 | -1.21% | -0.14% |
| 过去六个月          | -3.14%     | 0.43%         | -6.22%         | 0.55%                 | 3.08%  | -0.12% |
| 过去一年           | -4.36%     | 0.44%         | -9.56%         | 0.64%                 | 5.20%  | -0.20% |
| 过去三年           | 26.63%     | 0.47%         | 4.50%          | 0.65%                 | 22.13% | -0.18% |
| 过去五年           | 46.32%     | 0.60%         | 13.26%         | 0.64%                 | 33.06% | -0.04% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 63.24%     | 0.58%         | 22.14%         | 0.60%                 | 41.10% | -0.02% |

2. 博时鑫润混合C:

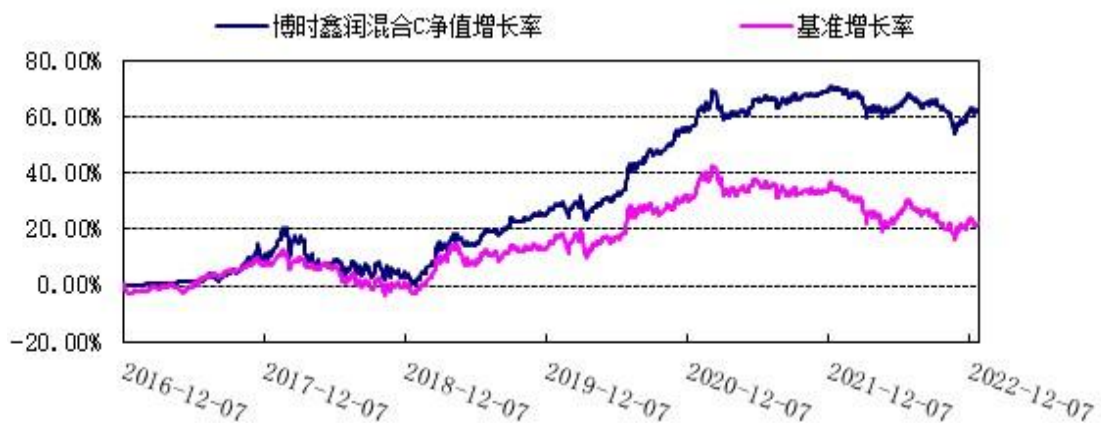
| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -0.26%     | 0.50%         | 0.98%          | 0.64%                 | -1.24% | -0.14% |
| 过去六个月          | -3.18%     | 0.43%         | -6.22%         | 0.55%                 | 3.04%  | -0.12% |
| 过去一年           | -4.42%     | 0.44%         | -9.56%         | 0.64%                 | 5.14%  | -0.20% |
| 过去三年           | 26.29%     | 0.47%         | 4.50%          | 0.65%                 | 21.79% | -0.18% |
| 过去五年           | 45.62%     | 0.60%         | 13.26%         | 0.64%                 | 32.36% | -0.04% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 62.82%     | 0.58%         | 22.14%         | 0.60%                 | 40.68% | -0.02% |

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

1. 博时鑫润混合A:



2. 博时鑫润混合C:



§4 管理人报告

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务   | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----|------|-------------|------|--------|---|
|    |      | 任职日期        | 离任日期 |        |   |
| 李睿 | 基金经理 | 2022-11-14  | -    | 7.4    | 李睿先生，博士。2015 年 7 月博士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员、基金经理助理。现任博时恒裕 6 个月持有期混合型证券投资基金、博时鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。现任博时鑫泰灵活配置混合型证券投资基金(2022 年 11 月 14 日—至今)、博时恒裕 6 个月持有期混合型证券投资基金(2022 年 11 月 14 日—至今)、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金(2022 年 11 月 14 日—至今)的基金经理，博时乐臻定期开放混合型证券投资基金、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金、博时鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、博时恒进 6 个月持有期混合型证券投资基金、博时恒旭一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理。   |
| 程卓 | 基金经理 | 2020-06-04  | -    | 10.3   | 程卓先生，硕士。2008 年起先后在招商银行总行、诺安基金工作。2017 年加入博时基金管理有限公司。历任博时安恒 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2018 年 4 月 2 日-2018 年 6 月 16 日)、博时安诚 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2018 年 5 月 28 日-2019 年 1 月 23 日)、博时聚源纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日-2019 年 3 月 19 日)、博时汇享纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日-2019 年 3 月 19 日)、博时安祺一年定期开放债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日-2019 年 8 月 22 日)、博时富宁纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日-2021 年 2 月 5 日)、博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 4 月 23 日-2021 年 2 月 5 日)、博时富永纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 12 月 19 日-2021 年 2 月 5 日)、博时裕嘉纯债 3 个月定期开放债券型发 |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | 起式证券投资基金(2019 年 3 月 11 日-2021 年 2 月 5 日)、博时悦楚纯债债券型证券投资基金(2019 年 6 月 4 日-2021 年 2 月 5 日)、博时富元纯债债券型证券投资基金(2019 年 2 月 25 日-2022 年 3 月 16 日)、博时安丰 18 个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)(2018 年 4 月 23 日-2022 年 9 月 9 日)的基金经理。现任博时安誉 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日—至今)、博时景兴纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日—至今)、博时民泽纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日—至今)、博时臻选纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日—至今)、博时智臻纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日—至今)、博时富嘉纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日—至今)、博时安泰 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日—至今)、博时安诚 3 个月定期开放债券型证券投资基金(2019 年 1 月 23 日—至今)、博时富诚纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日—至今)、博时裕盈纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2019 年 3 月 11 日—至今)、博时裕顺纯债债券型证券投资基金(2019 年 8 月 19 日—至今)、博时安祺 6 个月定期开放债券型证券投资基金(2019 年 8 月 22 日—至今)、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金(2020 年 6 月 4 日—至今)、博时裕丰纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2022 年 3 月 31 日—至今)的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 31 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度疫情防控政策大幅放开，房地产政策也显著放松。随着政策的显著放松，市场对增长的预期显著好转。但疫情防控政策放松初期，对经济的冲击依然较大，经济整体依然处于“强预期+弱现实”的状态。增长预期的修复，使得 4 季度的权益市场表现强于债券市场。在 4 季度末，由于理财赎回潮的冲击，导致信用债市场出现了较为显著的调整，这也对于组合的净值产生了较大的冲击。但近期随着理财赎回潮的结束，债券市场也出现了一定的回暖。年末信用债市场的冲击也抬高了组合的静态收益率，对于 2023 年的组合表现是较为有利的。在权益方面，我们的持仓依然偏重于消费龙头、银行龙头和低估值的制造业龙头，这些资产受益于增长预期的修复，2022 年 四季度，这些持仓也取得了较好的表现。

展望未来，我们认为随着增长的修复，增长敏感型资产可能会有相对更好的表现。消费、银行和低估值的制造业龙头也将贡献较好的绝对回报和相对回报。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.2875 元，份额累计净值为 1.5812 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.2843 元，份额累计净值为 1.5772 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 -0.23%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 -0.26%，同期业绩基准增长率为 0.98%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

---

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)          | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 63,579,140.92  | 29.16        |
|    | 其中：股票             | 63,579,140.92  | 29.16        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 126,824,823.77 | 58.17        |
|    | 其中：债券             | 126,824,823.77 | 58.17        |
|    | 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          | 20,010,717.80  | 9.18         |
|    | 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      | 7,580,994.23   | 3.48         |
| 8  | 其他各项资产            | 12,206.37      | 0.01         |
| 9  | 合计                | 218,007,883.09 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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              | 3,233,596.36  | 1.49         |
| C  | 制造业              | 35,664,129.35 | 16.38        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 8,194,351.70  | 3.76         |
| E  | 建筑业              | 13,333.32     | 0.01         |
| F  | 批发和零售业           | 1,277,979.04  | 0.59         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 502,038.66    | 0.23         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 20,274.24     | 0.01         |
| J  | 金融业              | 9,652,084.35  | 4.43         |
| K  | 房地产业             | 4,979,941.00  | 2.29         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 8,974.88      | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 14,851.88     | 0.01         |
| 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        | 17,586.14     | 0.01         |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 63,579,140.92 | 29.21        |



### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 7,341     | 12,677,907.00 | 5.82         |
| 2  | 000568 | 泸州老窖 | 48,800    | 10,944,864.00 | 5.03         |
| 3  | 600905 | 三峡能源 | 1,446,263 | 8,171,385.95  | 3.75         |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 96,150    | 4,519,050.00  | 2.08         |
| 5  | 000596 | 古井贡酒 | 13,200    | 3,523,080.00  | 1.62         |
| 6  | 000858 | 五粮液  | 15,408    | 2,784,071.52  | 1.28         |
| 7  | 000002 | 万科 A | 152,500   | 2,775,500.00  | 1.27         |
| 8  | 600036 | 招商银行 | 66,000    | 2,459,160.00  | 1.13         |
| 9  | 000333 | 美的集团 | 46,000    | 2,382,800.00  | 1.09         |
| 10 | 600048 | 保利发展 | 145,700   | 2,204,441.00  | 1.01         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 10,635,930.00  | 4.89         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 56,595,404.93  | 26.00        |
|    | 其中：政策性金融债 | 36,169,117.80  | 16.61        |
| 4  | 企业债券      | 45,969,910.14  | 21.12        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 5,111,068.49   | 2.35         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 8,512,510.21   | 3.91         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 126,824,823.77 | 58.26        |

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 200210 | 20 国开 10 | 200,000 | 20,443,550.68 | 9.39         |
| 2  | 175965 | 21 国投 01 | 100,000 | 10,289,677.81 | 4.73         |
| 3  | 175971 | 21 兴业 02 | 100,000 | 10,216,043.84 | 4.69         |
| 4  | 149490 | 21 申证 04 | 100,000 | 10,210,243.29 | 4.69         |
| 5  | 175991 | 国电投 02   | 100,000 | 10,206,927.12 | 4.69         |

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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。深圳市地铁集团有限公司在报告编制前一年受到深圳市交通运输局、深圳市福田区水务局的处罚。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。

### 5.11.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 11,760.57 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | 445.80    |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 12,206.37 |

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|--------------|--------------|
| 1  | 132015 | 18 中油 EB | 3,173,246.30 | 1.46         |
| 2  | 110053 | 苏银转债     | 2,502,795.74 | 1.15         |
| 3  | 132018 | G 三峡 EB1 | 815,285.18   | 0.37         |
| 4  | 113052 | 兴业转债     | 401,148.67   | 0.18         |
| 5  | 110079 | 杭银转债     | 310,263.95   | 0.14         |
| 6  | 113050 | 南银转债     | 150,355.64   | 0.07         |
| 7  | 132014 | 18 中化 EB | 129,386.69   | 0.06         |
| 8  | 113632 | 鹤 21 转债  | 108,575.40   | 0.05         |
| 9  | 127025 | 冀东转债     | 94,319.95    | 0.04         |
| 10 | 123107 | 温氏转债     | 88,483.51    | 0.04         |
| 11 | 113545 | 金能转债     | 87,490.99    | 0.04         |
| 12 | 113021 | 中信转债     | 85,649.81    | 0.04         |
| 13 | 132022 | 20 广版 EB | 73,537.74    | 0.03         |
| 14 | 128085 | 鸿达转债     | 72,866.06    | 0.03         |
| 15 | 128081 | 海亮转债     | 60,577.40    | 0.03         |
| 16 | 110060 | 天路转债     | 47,415.35    | 0.02         |
| 17 | 110062 | 烽火转债     | 45,821.00    | 0.02         |
| 18 | 113025 | 明泰转债     | 43,962.21    | 0.02         |
| 19 | 110061 | 川投转债     | 35,731.92    | 0.02         |
| 20 | 113534 | 鼎胜转债     | 34,085.74    | 0.02         |
| 21 | 113030 | 东风转债     | 26,943.65    | 0.01         |
| 22 | 110057 | 现代转债     | 23,625.86    | 0.01         |
| 23 | 128100 | 搜特转债     | 23,199.14    | 0.01         |
| 24 | 110055 | 伊力转债     | 19,439.20    | 0.01         |
| 25 | 128062 | 亚药转债     | 17,775.34    | 0.01         |
| 26 | 110052 | 贵广转债     | 15,052.42    | 0.01         |
| 27 | 113024 | 核建转债     | 13,880.53    | 0.01         |
| 28 | 123022 | 长信转债     | 7,468.81     | 0.00         |
| 29 | 127006 | 敖东转债     | 1,172.41     | 0.00         |
| 30 | 110067 | 华安转债     | 1,078.58     | 0.00         |

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目             | 博时鑫润混合A    | 博时鑫润混合C        |
|----------------|------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 733,026.97 | 168,976,091.10 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 47,029.45  | 26,738.90      |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 126,784.09 | 147,346.07     |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -          | -              |
| 本报告期期末基金份额总额   | 653,272.33 | 168,855,483.93 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                          |               |      |      | 报告期末持有基金情况    |        |
|-------|----------------|--------------------------|---------------|------|------|---------------|--------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构    | 1              | 2022-10-01~2022-12-31    | 58,060,631.96 | -    | -    | 58,060,631.96 | 34.25% |

#### 产品特有风险

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

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

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后

本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 50% 或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50% 时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2022 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 341 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 15141 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 5227 亿元人民币，累计分红逾 1778 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。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 9.3 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

二〇二三年一月二十日