

**博时浦惠一年持有期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	博时浦惠一年持有期混合
基金主代码	014158
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 2 月 17 日
报告期末基金份额总额	421,889,531.51 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，力争实现组合资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略和债券投资策略。其中，资产配置策略是指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别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。股票投资策略是指将结合定量、定性分析，考察和筛选未被充分定价的、具备增长潜力的个股，综合行业选择与配置、竞争力分析、管理层分析、财务指标分析、估值比较、交易策略等因素，辅以港股通标的股票和存托凭证投资策略来进行股票投资。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、可转换债券及可交换债券投资策略等。其他资产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、参与融资业务的投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×25%+中证港股通综合指数（CNY）收益率×5%+中债综合财富（总值）指数收益率×70%

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。	
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	博时浦惠一年持有期混合 A	博时浦惠一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	014158	014159
报告期末下属分级基金的份额总额	385,414,974.45 份	36,474,557.06 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 (2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日)	
	博时浦惠一年持有期混合 A	博时浦惠一年持有期混合 C
1.本期已实现收益	-708,828.45	-103,722.50
2.本期利润	-2,781,626.40	-299,020.60
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0072	-0.0082
4.期末基金资产净值	384,304,580.28	36,243,339.49
5.期末基金份额净值	0.9971	0.9937

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. 博时浦惠一年持有期混合A:

阶段	净值增长率 ①	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
过去三个月	-0.72%	0.59%	1.28%	0.39%	-2.00%	0.20%
过去六个月	-4.16%	0.58%	-2.69%	0.33%	-1.47%	0.25%
自基金合同 生效起至今	-0.29%	0.52%	-2.81%	0.40%	2.52%	0.12%

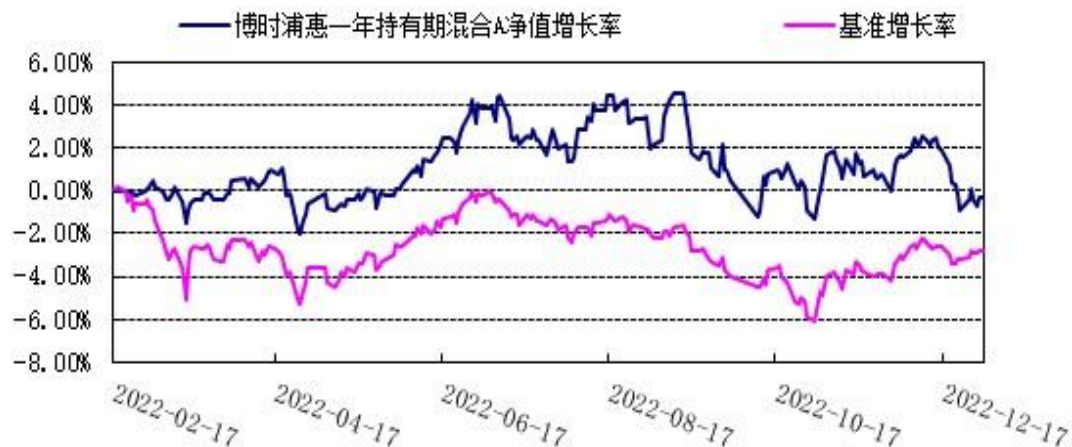
###### 2. 博时浦惠一年持有期混合C:

阶段	净值增长率	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

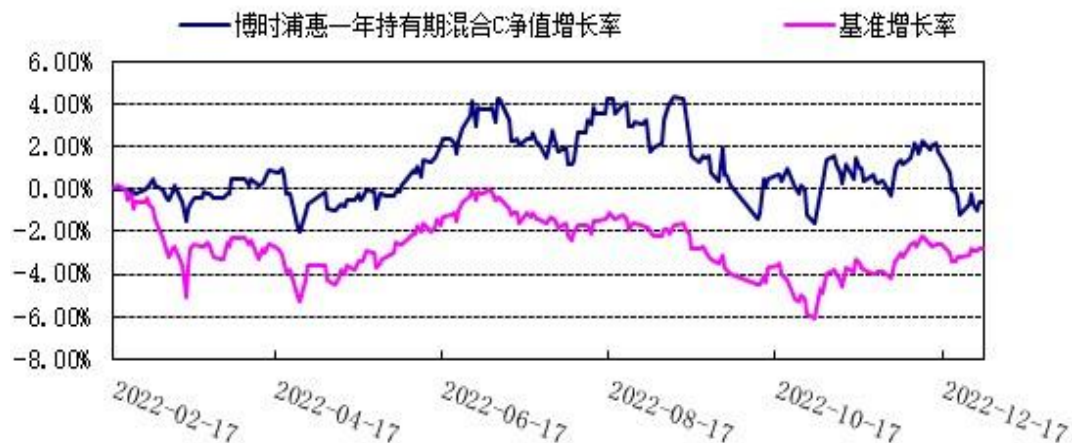
	①	标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	-0.82%	0.59%	1.28%	0.39%	-2.10%	0.20%
过去六个月	-4.35%	0.58%	-2.69%	0.33%	-1.66%	0.25%
自基金合同生效起至今	-0.63%	0.52%	-2.81%	0.40%	2.18%	0.12%

### 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. 博时浦惠一年持有期混合A:



#### 2. 博时浦惠一年持有期混合C:



注：本基金的基金合同于 2022 年 2 月 17 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		
过钧	首席基金经理/基金经理	2022-02-17	-	21.4	过钧先生，硕士。1995 年起先后在上海工艺品进出口公司、德国德累斯顿银行上海分行、美国 Lowes 食品有限公司、美国通用电气公司、华夏基金固定收益部工作。2005 年加入博时基金管理有限公司。历任博时稳定价值债券投资基金(2005 年 8 月 24 日-2010 年 8 月 4 日)基金经理、固定收益部副总经理、博时转债增强债券型证券投资基金(2010 年 11 月 24 日-2013 年 9 月 25 日)、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金(2013 年 2 月 1 日-2014 年 4 月 2 日)、博时裕祥分级债券型证券投资基金(2014 年 1 月 8 日-2014 年 6 月 10 日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2013 年 9 月 13 日-2015 年 7 月 16 日)、博时新财富混合型证券投资基金(2015 年 6 月 24 日-2016 年 7 月 4 日)、博时新机遇混合型证券投资基金(2016 年 3 月 29 日-2018 年 2 月 6 日)、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 8 月 1 日-2018 年 2 月 6 日)、博时稳健回报债券型证券投资基金 (LOF)(2014 年 6 月 10 日-2018 年 4 月 23 日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2016 年 10 月 24 日-2018 年 5 月 5 日)、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 2 月 10 日-2018 年 5 月 21 日)、博时鑫和灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 12 月 13 日-2018 年 6 月 16 日)、博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 1 月 10 日-2018 年 7 月 30 日)的基金经理、固定收益总部公募基金组负责人、博时新价值灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 3 月 29 日-2019 年 4 月 30 日)、博时乐臻定期开放混合型证券投资基金(2016 年 9 月 29 日-2019 年 10 月 14 日)、博时转债增强债券型证券投资基金(2019 年 1 月 28 日-2020 年 4 月 3 日)、博时鑫源灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 9 月 6 日-2020 年 7 月 20

					日)、博时新起点灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 10 月 17 日-2020 年 7 月 20 日)、博时鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 2 月 10 日-2020 年 7 月 20 日)、博时中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金(2019 年 7 月 19 日-2020 年 10 月 26 日)的基金经理、固定收益总部指数与创新组负责人、公司董事总经理、博时中债 3-5 年进出口行债券指数证券投资基金(2018 年 12 月 25 日-2021 年 8 月 17 日)基金经理。现任首席基金经理兼博时信用债券投资基金(2009 年 6 月 10 日—至今)、博时新收益灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 2 月 29 日—至今)、博时双季鑫 6 个月持有期混合型证券投资基金(2021 年 1 月 20 日—至今)、博时浦惠一年持有期混合型证券投资基金(2022 年 2 月 17 日—至今)、博时恒耀债券型证券投资基金(2022 年 11 月 10 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遵规守信情况的说明

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，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

## 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

随着 12/15 美联储完成年内第七次加息，最终使得全年加息幅度达到 425bps，仅在四季度就加息三次共 200bps，加息速度史无前例，基准利率也达到 10 年来最高点，也把市场预期中值达到 5-5.25% 的水平。本次加息与特朗普时代不同：本轮加息周期中长期利率很快倒挂，显示市场对美国经济的信心比 5 年前远为不足。而反观中国，本季度防疫政策的优化调整标志着全世界进入一个与新冠病毒共存的新时代。尽管今年中国经济与全世界的差距并未延续前两年的领先优势，但累计三年，中国经济的强势还是十分明显。大疫三年，对中国经济增速的影响还是显而易见：中国经济增速进一步下台阶到 5% 以下，叠加防疫成本，造成了巨大的潜在损失。但随着中国重启经济增长模式，全球经济新竞争将重新开始。4Q 中美科技摩擦升级，两国间竞争的长期化不可避免。作为第二个 GDP 总量达到美国 70% 和第二个 GDP 总量超越 10 万亿美元的国家，中国是依靠经济增长，而非本币升值，达到这个目标的国家，对美国造成的威胁也远超之前的日本。防疫政策的变化带来经济转好的乐观看法，人民币汇率在四季度见底回升；日本央行调整 YCC 政策造成日元升值也是美元指数回落的重要因素，有助于缓解人民币贬值压力。如明年美国经济衰退预期降低通胀水平，美国加息周期可能因此结束，但美联储可能会维持高利率相当长的时间，利率下降幅度可能会有限。不管如何，历史上低利率时代可能回不来了。

本季度随着防疫政策优化的实施，市场对经济看法趋于乐观，收益率回升，市场走出熊平走势，短端利率上升幅度大于中长债。全年疫情防控造成的消费疲软和地产调控的产业链收缩，在 4Q 预期反转，也是本轮债市调整的主因。本季度的降准也无助于债市的企稳。我们认为防控的放松意味着经济的复苏周期可能就要开始，过去五年的结构性调整也接近尾声，经济增长将成为新一届政府的主要关注点，扩张性财政政策将成为未来经济的重要抓手。与各发达国家刺激政策退坡不同，与全世界相比较低的中央政府财政赤字将成为政府加杠杆的重要底气。今年社融受制于防疫和地产压制，宽信用在今年始终是难点，明年是否能恢复，需要看政策力度的大小。三年的疫情造成许多企业和产能退出市场，如果经济企稳复苏，短期内造成的供需不平衡可能会造成物价水平的上升，尤其是非食品项目的同比涨幅可能会超预期，但整体物价上升幅度可能有限，不太会成为主要的风险因素。我们今年一直维持低久期利率债策略，尽管本季度收益率回升并超越年初水平，但考虑到疫情放松后经济的复苏方向是确定的，我们依旧对债市持谨慎态度，可能在明年会有更好的买入时点。我们本季度继续维持低久期利率债策略。

如上季度所述，信用债收益率持续下行导致信用利差处于历史极低水平，这种情况终于在 4 季度快速逆转：高等级信用利差从低点上行 70-80bps，低等级信用利差则上行超过 100bps，回到 2020 年上半年水平。等级利差则大幅上行，超越近 4 年高点，也回到了历史平均水平附近。信用债市场的调整一方面是债市本

身调整的需要和信用利差偏低导致，另一方面今年市场大部分时间处于理财产品配需需求大幅上升，在过度追逐收益率情况下形成过于一致的交易策略。本季度债券收益率上行，理财产品持有人普遍未体验过之前债券熊市波动，赎回冲击放大了信用债市场的流动性风险。由于理财产品是信用债持有大户，目前理财产品这种年化收益率计价方式使得全价回报最大化策略无法实施，持有人普遍有保本保收益心态，而净值化又使得波动加大并可能造成到期亏损风险。市场发展到今天，不可能重回以前预期收益率类保本理财的老路，但目前净值化改革留下年化收益率尾巴使得客户对净值波动的容忍度依旧较低，市场波动明显上升。加强投资者教育稳定理财产品规模是未来保证信用债需求的关键。明年防疫松动，经济增长将成为宏观主线，市场利率可能上升，对信用债的影响可能还要持续。尽管目前信用利差回到历史均值附近，但还未进入特别吸引力区间。相对而言，城投重质、产业债重久期、二永债收益率处于较高水平，可能是未来投资的主要方向。我们本季度继续维持信用债零配置。

本季度股市受疫情影响反复表现不佳，回撤较大，转债市场也出现快速下跌。偏股型转债跌幅最大，市场重新跌回 4 月份低点。纯债市场的大幅波动也对转债市场的资金面造成不利影响：理财产品的赎回使得一切流动性好的资产都受到波及，转债市场也不例外。伴随着市场炒作降温，新券破发重现，市价中位数重新回到历史中低水平，转债估值再次压缩，但整体估值依旧处于历史偏高水平，尤其对于偏债型和平衡型转债而言。与以往熊市末期不同，本轮熊市转债市场在估值上未能重现以前低点，从期权角度上也偏贵；一方面体现了市场的深度和参与者的大幅扩张，另一方面反映了市场对后市的乐观情绪。不得不承认，与以往熊市底部相比，此次转债的整体估值难言再大幅扩张，但部分品种依旧具有投资价值，尤其是部分转股价值处于较低水平的偏股型品种。本季度本基金依旧主要参与一级市场。

三年的防疫调控在本季度走向了终点。伴随着市场对于政策预期的不断变化和经济受到疫情冲击的持续疲软，本季度股市总体震荡，但也未回到 4 月低点。与 4 月不同的是：这次疫情的影响是能看到政策对经济影响的结局，而 4 月份那次则不是。经济三驾马车中，净出口受制于明年出口市场的衰退预期，投资将保持平稳，基建更多的是作为经济下行的对冲工具；全年的经济将更多的依赖于消费拉动。我国居民净存款已经达到历史最高值，能否修复取决于居民的消费倾向和消费信心能否恢复，均值回复是不是能重新改变居民自 18 年以来不断上升的存款额？而消费的复苏强弱则决定明年经济增长水平的关键。今年 1-10 月中国消费零售市场达到 5.4 万亿美元，和美国同期相比差距扩大了 10 个百分点，反映了疫情调控下对经济的影响。经济增长在海外可能是现实的衰退，在国内则是政策优化后的反弹，其力度则是明年各大大类资产表现的決定因素。如能强劲复苏，则股市的盈利和估值都能回升；如只是弱复苏，则股市将更多的呈现结构性行情，盈利增长将更重要。明年广义财政力度可能是近 10 年新高，但比不上 09 年那样的力度。从历史上看，外部的衰退不必然导致我国股市的熊市，但上涨幅度可能会因此受影响。本季度我们继续维持组合权益高仓位，并对部分持仓进行了调整，增加了对疫情后复苏预期受益的品种。



综上所述，展望明年一季度，我们预计过去五年的结构性调整将进入尾声，经济增长将成为新一届政府的主要关注点。大疫三年较克制的刺激经济措施和较低的中央财政赤字使得我国有能力和工具对冲外部经济的不利局面。经济数据有望逐步稳步回升，经济将逐步摆脱疫情防控的影响。我们观点较之前更为乐观：基本上债券市场利率债收益率可能再次逐步上行，但高点取决于经济恢复的力度；信用债估值风险大部分释放，信用利差也进入合理区间，我们希冀寻找更好的进入时点。权益市场机会大于今年，三次重回 3000 点的市场给投资者提供了足够的时间进行品种选择；转债市场，我们看好部分正股有机会、转股溢价率合理的转债品种，尽管未能在 4Q 完成转股，但明年应该能给投资者从容获利离场的机会。

#### 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 0.9971 元，份额累计净值为 0.9971 元，本基金 C 类基金份额净值为 0.9937 元，份额累计净值为 0.9937 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 -0.72%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 -0.82%，同期业绩基准增长率为 1.28%。

#### 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	206,665,152.07	49.08
	其中：股票	206,665,152.07	49.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	23,013,905.98	5.47
	其中：债券	23,013,905.98	5.47
	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	162,066,696.29	38.49
	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	29,286,943.20	6.96
8	其他各项资产	43,264.21	0.01
9	合计	421,075,961.75	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	42,747,187.20	10.16
C	制造业	87,525,675.96	20.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,235,000.00	1.24
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	31,637,500.00	7.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,628.91	0.01
J	金融业	39,467,160.00	9.38
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	206,665,152.07	49.14

## 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	600256	广汇能源	2,200,000	19,844,000.00	4.72
2	002216	三全食品	900,000	16,659,000.00	3.96
3	300260	新莱应材	229,900	15,426,290.00	3.67
4	601838	成都银行	1,000,000	15,300,000.00	3.64
5	601899	紫金矿业	1,450,000	14,500,000.00	3.45
6	600926	杭州银行	1,077,000	14,087,160.00	3.35
7	600029	南方航空	1,500,000	11,400,000.00	2.71
8	605358	立昂微	250,052	10,652,215.20	2.53
9	601111	中国国航	1,000,000	10,600,000.00	2.52
10	603733	仙鹤股份	341,800	10,414,646.00	2.48

## 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	20,404,191.78	4.85
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,609,714.20	0.62
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	23,013,905.98	5.47

### 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	019666	22 国债 01	200,000	20,404,191.78	4.85
2	111010	立昂转债	12,520	1,537,475.55	0.37
3	113055	成银转债	5,540	664,873.46	0.16
4	132026	G 三峡 EB2	3,830	403,938.24	0.10
5	118015	芯海转债	10	1,189.74	0.00

### 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，成都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眉山监管局、中国人民银行成都分行的处罚。杭州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深圳监管局、中国人民银行杭州中心支行的处罚。中国国际航空股份有限公司受到中国民用航空华东地区管理局的处罚。中国南方航空股份有限公司受到中国民用航空中南地区管理局的处罚。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	31,608.87
2	应收证券清算款	10,319.12
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,336.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,264.21

#### 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	113055	成银转债	664,873.46	0.16

#### 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	博时浦惠一年持有期混合A	博时浦惠一年持有期混合C
本报告期期初基金份额总额	385,090,800.63	36,462,686.99
报告期期间基金总申购份额	324,173.82	11,870.07
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	385,414,974.45	36,474,557.06

## §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

单位：份

项目	博时浦惠一年持有期混合A	博时浦惠一年持有期混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	20,007,200.36	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	20,007,200.36	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	4.74	-

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.基金管理人博时基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

### 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

无。

### 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浦惠一年持有期混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时浦惠一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时浦惠一年持有期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、报告期内博时浦惠一年持有期混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 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