

博时双季享六个月持有期债券型证券投资
资基金
2023 年中期报告
2023 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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

§ 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 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.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
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.....	36
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.....	37
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.....	37
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.....	37
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37

7.12 投资组合报告附注	37
§ 8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	38
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	39
§ 9 开放式基金份额变动	39
§ 10 重大事件揭示	39
10.1 基金份额持有人大会决议	39
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	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	40
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	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8 其他重大事件	41
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	42
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	42
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	42
§ 12 备查文件目录	42
12.1 备查文件目录	42
12.2 存放地点	43
12.3 查阅方式	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金		
基金简称	博时双季享持有期债券		
基金主代码	010223		
交易代码	010223		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020 年 10 月 13 日		
基金管理人	博时基金管理有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	59,009,004.91 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	博时双季享持有期债券 A	博时双季享持有期债券 B	博时双季享持有期债券 C
下属分级基金的交易代码	010223	010226	010227
报告期末下属分级基金的份额总额	14,607,466.81 份	461,464.37 份	43,940,073.73 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
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相补充的方法，确定资产在固定收益类证券之间的配置比例。充分发挥基金管理人长期积累的信用研究成果，利用自主开发的信用分析系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，以获取最大化的信用溢价。本基金采用的投资策略包括：期限结构策略、信用债投资策略、互换策略、息差策略等。在谨慎投资的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。本基金灵活应用各种期限结构策略、信用债投资策略、互换策略、息差策略等。本基金将投资组合的平均剩余期限控制在 2 年以内，在控制利率风险、在合理管理并控制组合风险的前提下，最大化组合收益。
业绩比较基准	中债总财富（1-3 年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。

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	中信银行股份有限公司
信息披露 姓名	孙麒清	姜敏

负责人	联系电话	0755-83169999	4006800000
	电子邮箱	service@bosera.com	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		95105568	95558
传真		0755-83195140	010-85230024
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		518040	100020
法定代表人		江向阳	朱鹤新

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	北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301

§ 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（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）		
	博时双季享持有期债券 A	博时双季享持有期债券 B	博时双季享持有期债券 C
本期已实现收益	269,176.90	6,370.12	933,355.39
本期利润	417,256.82	9,623.84	1,597,542.86
加权平均基金份额本期利润	0.0373	0.0357	0.0358
本期加权平均净值利润率	3.47%	3.34%	3.36%
本期基金份额净值增长率	3.62%	3.46%	3.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 6 月 30 日）		
	博时双季享持有期债券 A	博时双季享持有期债券 B	博时双季享持有期债券 C
期末可供分配利润	1,361,544.13	38,957.97	3,641,274.32

期末可供分配基金份额利润	0.0932	0.0844	0.0829
期末基金资产净值	15,969,010.94	500,422.34	47,581,348.05
期末基金份额净值	1.0932	1.0844	1.0829
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)		
	博时双季享持有期债券 A	博时双季享持有期债券 B	博时双季享持有期债券 C
基金份额累计净值增长率	9.32%	8.44%	8.29%

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

博时双季享持有期债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.44%	0.03%	0.28%	0.03%	0.16%	0.00%
过去三个月	2.00%	0.04%	0.98%	0.02%	1.02%	0.02%
过去六个月	3.62%	0.04%	1.47%	0.02%	2.15%	0.02%
过去一年	4.34%	0.06%	2.62%	0.03%	1.72%	0.03%
自基金合同生效起至今	9.32%	0.06%	8.39%	0.03%	0.93%	0.03%

博时双季享持有期债券 B

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	0.42%	0.03%	0.28%	0.03%	0.14%	0.00%
过去三个月	1.93%	0.04%	0.98%	0.02%	0.95%	0.02%
过去六个月	3.46%	0.04%	1.47%	0.02%	1.99%	0.02%
过去一年	4.03%	0.06%	2.62%	0.03%	1.41%	0.03%
自基金合同生效起至今	8.44%	0.06%	8.39%	0.03%	0.05%	0.03%

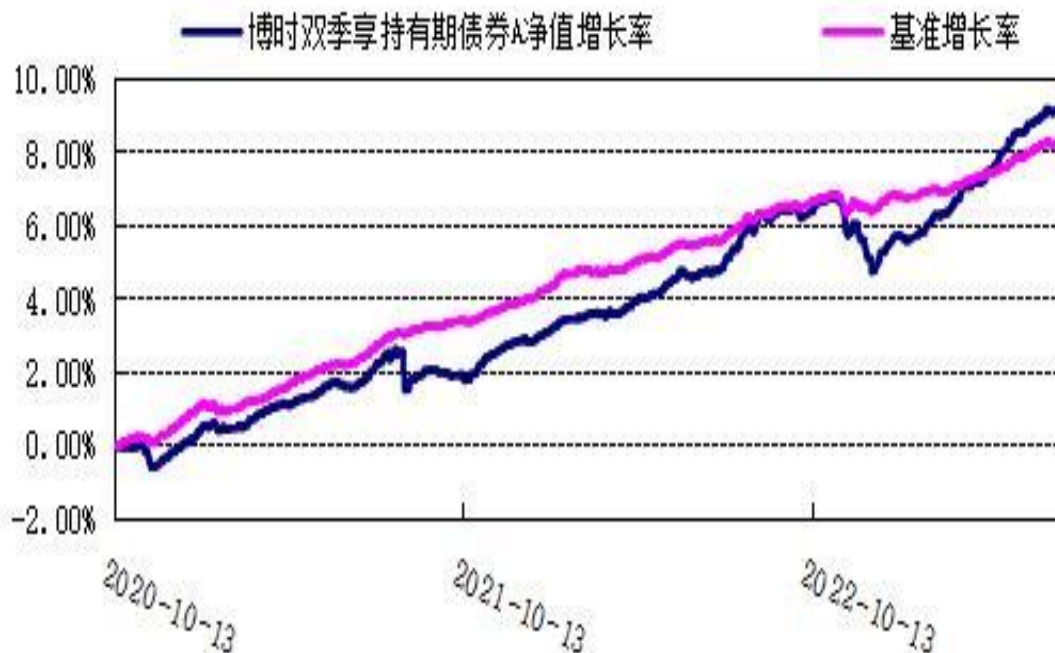
博时双季享持有期债券 C

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	0.42%	0.03%	0.28%	0.03%	0.14%	0.00%
过去三个月	1.91%	0.04%	0.98%	0.02%	0.93%	0.02%

过去六个月	3.44%	0.04%	1.47%	0.02%	1.97%	0.02%
过去一年	3.98%	0.06%	2.62%	0.03%	1.36%	0.03%
自基金合同生效起至今	8.29%	0.05%	8.39%	0.03%	-0.10%	0.02%

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

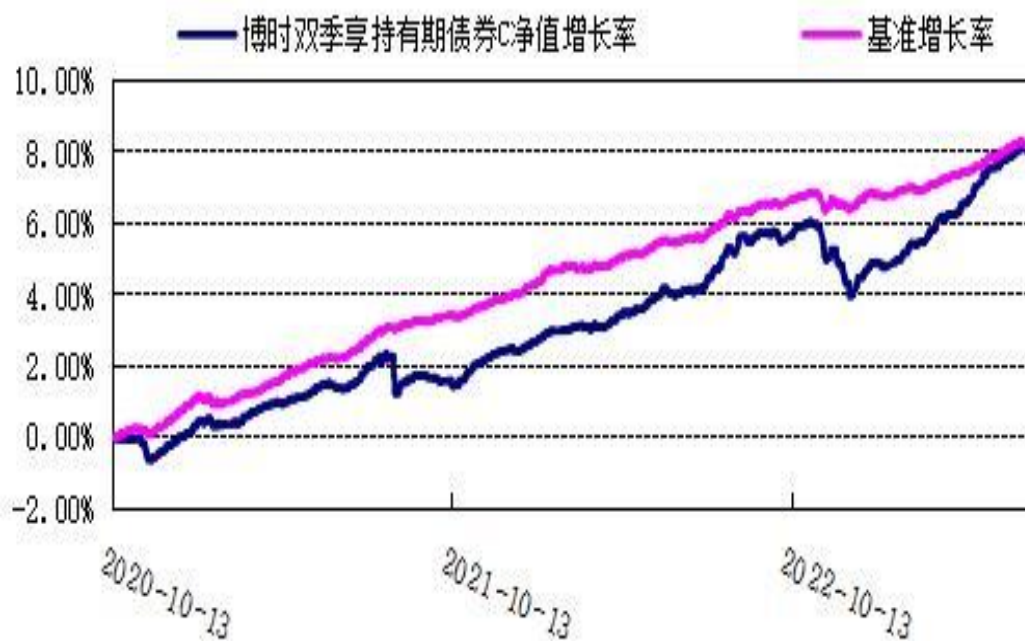
博时双季享持有期债券 A



博时双季享持有期债券 B



博时双季享持有期债券 C



§ 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 2023 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 355 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 14767 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 5220 亿元人民币，累计分红逾 1851 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		
张李陵	固定收益投资三部总经理/ 固定收益投资三部投资总监 /基金经理	2020-10-13	2023-04-25	10.9	张李陵先生，硕士。2006 年起先后在招商银行、融通基金、博时基金、招银理财工作。2014 年加入博时基金管理有限公司。历任投资经理、投资经理兼基金经理助理、博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金(2016 年 8 月 1 日-2017 年 6 月 27 日)、博时泰安债券型证券投资基金(2016 年 12 月 27 日-2018 年 3 月 8 日)、博时泰和债券型证券投资基金(2016 年 7 月 13 日-2018 年 3 月 9 日)、博时富鑫纯债债券型证券投资基金(2017 年 2 月 10 日-2018 年 7 月 16 日)、博时稳定价值债券投资基金(2015 年 5 月 22 日-2020 年 2 月 24 日)、博时平衡配置混合型证券投资基金(2015 年 7 月 16 日-2020 年 2 月 24 日)、博时天颐债券型证券投资基金(2016 年 8 月 1 日-2020 年 2 月 24 日)、博时信用债纯债债券型证券投资基金(2015 年 7 月 16 日-2020 年 3 月 11

					<p>日)、博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金(2020年10月13日-2023年4月25日)的基金经理。2020年再次加入博时基金管理有限公司。现任固定收益投资三部总经理兼固定收益投资三部投资总监、博时信用债纯债债券型证券投资基金(2020年7月13日一至今)、博时恒泽混合型证券投资基金(2021年2月8日一至今)、博时恒泰债券型证券投资基金(2021年4月22日一至今)、博时博盈稳健6个月持有期混合型证券投资基金(2021年8月10日一至今)、博时稳益9个月持有期混合型证券投资基金(2021年11月9日一至今)、博时富鑫纯债债券型证券投资基金(2021年11月23日一至今)、博时恒益稳健一年持有期混合型证券投资基金(2022年4月14日一至今)、博时双季乐六个月持有期债券型证券投资基金(2022年4月15日一至今)、博时恒乐债券型证券投资基金(2022年4月28日一至今)的基金经理。</p>
李禹成	基金经理	2022-06-15	-	6.9	<p>李禹成先生，硕士。2016年至2019年在泰康资产管理有限公司工作。2019年加入博时基金管理有限公司。曾任投资经理助理。现任博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金(2022年6月15日一至今)、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(2023年3月23日一至今)、博时富发纯债债券型证券投资基金(2023年4月3日一至今)的基金经理，博时恒泽混合型证券投</p>

					资基金、博时恒乐债券型证券投资基金、博时恒益稳健一年持有期混合型证券投资基金、博时双季乐六个月持有期债券型证券投资基金、博时信用债纯债债券型证券投资基金的基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

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，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 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 89 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，市场围绕基本面的现实与预期之间的矛盾变化，市场信心偏弱和保持定力之间的影响间震荡前行。一季度，在疫情管控放开，地产限制放松，金融数据表现较强的情况下，对于基本面的修复预期较强，风险偏好提升，市场情绪偏向于弱现实，强预期，股强债弱的预期较强，伴随 2 月份跨年后，资金面维持紧张，市场担忧情绪加重，市场震荡调整。最终在两会过后，经济目标的

确定，致使强刺激预期落空，市场焦点转向为强现实，弱预期，且美国个别银行暴雷，美联储暗示加息或接近尾声，海外衰退预期加强，债市表现转为强势。二季度，市场对于基本面预期在高频数据转弱的情况下快速升温，虽然股债性价比问题凸显，但预期较弱，叠加海外风险时间频发，央行呵护，资金利率维持较低，债券收益显著下行。后进入 6 月份，市场博弈后期经济政策刺激的出台，收益率开始震荡，在政策逐步出台下，收益有所调整，但调整空间有限，后续仍需关注刺激政策出台的节奏和力度。信用债方面，上半年在理财发行规模回升，需求回暖，信贷替代效应下信用债发行较少，供给不足，整体供需格局失衡，信用债合意资产荒持续，信用利差快速压缩，处于较低位置，配置压力仍存。

上半年，组合整体保持相对较高的杠杆和灵活的久期，针对市场变动，进行久期和杠杆的调节，同时，积极挑选性价比较高的信用债填充仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0932 元，份额累计净值为 1.0932 元，本基金 B 类基金份额净值为 1.0844 元，份额累计净值为 1.0844 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0829 元，份额累计净值为 1.0829 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 3.62%，本基金 B 类基金份额净值增长率为 3.46%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 3.44%，同期业绩基准增长率为 1.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，关键仍需观察政策出台的力度及节奏以及在此基础上，风险偏好的恢复情况。目前来看，政策有所松动，但宏观环境仍对债市相对有利，基本面的修复还需要时间，市场预期还未转向，债市短期调整风险不大，但需要紧密关注较强刺激出台，股债性价比对比显著的情况下，对债市形成的调整压力。组合策略上，坚持票息策略，获取货币政策宽松下的套息收益，同时保留组合较好的流动性，应对市场后续可能有的波动，同时在中性久期的基础上，灵活把握交易机会，关注品种溢价和银行二永交易机配置机会，力争获取超额收益。

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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金 2023 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，博时基金管理有限公司在博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作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的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，博时基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2023 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	1,934,392.73	644,765.85
结算备付金		27,548.52	140,040.70
存出保证金		898.83	1,365.74
交易性金融资产	6.4.3.2	71,688,904.97	79,979,958.34
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		71,688,904.97	79,979,958.34
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-1,277.26	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-
应收清算款		3,701,915.89	199,237.04
应收股利		-	-
应收申购款		72,347.59	10,237.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		77,424,731.27	80,975,605.55

负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		13,094,579.05	19,558,789.90
应付清算款		-	-
应付赎回款		145,928.16	150,510.80
应付管理人报酬		15,259.16	16,060.70
应付托管费		2,543.19	2,676.78
应付销售服务费		13,523.63	15,027.98
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,713.49	5,523.23
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	94,403.26	75,402.53
负债合计		13,373,949.94	19,823,991.92
净资产：			
实收基金	6.4.3.8	59,009,004.91	58,321,951.89
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	5,041,776.42	2,829,661.74
净资产合计		64,050,781.33	61,151,613.63
负债和净资产总计		77,424,731.27	80,975,605.55

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 59,009,004.91 份。其中 A 类基金份额净值 1.0932 元，基金份额总额 14,607,466.81 份；B 类基金份额净值 1.0844 元，基金份额总额 461,464.37 份；C 类基金份额净值 1.0829 元，基金份额总额 43,940,073.73 份。

6.2 利润表

会计主体：博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
一、营业总收入		2,523,491.32	2,423,133.66
1. 利息收入		8,715.18	25,117.37
其中：存款利息收入	6.4.3.10	6,190.11	9,691.93
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		2,525.07	15,425.44
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,699,255.03	3,121,528.35
其中：股票投资收益	6.4.3.11	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	1,699,255.03	3,121,528.35
资产支持证券投资收益	6.4.3.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	-	-
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）	6.4.3.16	815,521.11	-723,512.06
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-	-
减：二、营业总支出		499,067.80	637,559.36
1. 管理人报酬		89,124.55	168,528.73
2. 托管费		14,854.10	28,088.10
3. 销售服务费		83,017.05	160,548.89
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		206,817.87	160,864.43
其中：卖出回购金融资产支出		206,817.87	160,864.43
6. 信用减值损失	6.4.3.18	-	-
7. 税金及附加		4,140.45	6,872.10
8. 其他费用	6.4.3.19	101,113.78	112,657.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,024,423.52	1,785,574.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,024,423.52	1,785,574.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,024,423.52	1,785,574.30

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023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）	58,321,951.89	-	2,829,661.74	61,151,613.63
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）	58,321,951.89	-	2,829,661.74	61,151,613.63
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	687,053.02	-	2,212,114.68	2,899,167.70
（一）、综合收益总额	-	-	2,024,423.52	2,024,423.52
（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）	687,053.02	-	187,691.16	874,744.18
其中：1. 基金申购款	20,178,965.11	-	1,409,190.79	21,588,155.90
2. 基金赎回款	-19,491,912.09	-	-1,221,499.63	-20,713,411.72
（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）	59,009,004.91	-	5,041,776.42	64,050,781.33
项目	上年度可比期间 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）	150,879,436.87	-	4,026,059.45	154,905,496.32

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)	150,879,436.87	-	4,026,059.45	154,905,496.32
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-67,740,383.70	-	-476,846.21	-68,217,229.91
(一)、综合收益总额	-	-	1,785,574.30	1,785,574.30
(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)	-67,740,383.70	-	-2,262,420.51	-70,002,804.21
其中：1. 基金申购款	9,043,769.86	-	316,528.12	9,360,297.98
2. 基金赎回款	-76,784,153.56	-	-2,578,948.63	-79,363,102.19
(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)	83,139,053.17	-	3,549,213.24	86,688,266.41

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：徐卫，会计机构负责人：倡方方

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

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。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的

通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	1,934,392.73
等于：本金	1,934,050.69
加：应计利息	342.04
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	1,934,392.73

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	21,216,864.11	204,566.79	21,482,446.79	61,015.89
	银行间市场	49,293,855.46	559,158.18	50,206,458.18	353,444.54
	合计	70,510,719.57	763,724.97	71,688,904.97	414,460.43
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	70,510,719.57	763,724.97	71,688,904.97	414,460.43	

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 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 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-1,277.26	-
银行间市场	-	-

合计	-1,277.26	-
----	-----------	---

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.5 其他权益工具投资

6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	5,760.10
其中：交易所市场	-
银行间市场	5,760.10
应付利息	-
预提费用	88,643.16
合计	94,403.26

6.4.3.8 实收基金

博时双季享持有期债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	11,611,353.91	11,611,353.91
本期申购	5,535,860.50	5,535,860.50
本期赎回（以“-”号填列）	-2,539,747.60	-2,539,747.60
本期末	14,607,466.81	14,607,466.81

博时双季享持有期债券 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额

上年度末	191,706.44	191,706.44
本期申购	346,899.00	346,899.00
本期赎回（以“-”号填列）	-77,141.07	-77,141.07
本期末	461,464.37	461,464.37

博时双季享持有期债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	46,518,891.54	46,518,891.54
本期申购	14,296,205.61	14,296,205.61
本期赎回（以“-”号填列）	-16,875,023.42	-16,875,023.42
本期末	43,940,073.73	43,940,073.73

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)。

6.4.3.9 未分配利润
博时双季享持有期债券 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	856,477.01	-217,373.80	639,103.21
本期利润	269,176.90	148,079.92	417,256.82
本期基金份额交易产生的变动数	296,497.83	8,686.27	305,184.10
其中：基金申购款	497,148.75	-25,398.33	471,750.42
基金赎回款	-200,650.92	34,084.60	-166,566.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,422,151.74	-60,607.61	1,361,544.13

博时双季享持有期债券 B

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	12,784.05	-3,567.10	9,216.95
本期利润	6,370.12	3,253.72	9,623.84
本期基金份额交易产生的变动数	21,713.65	-1,596.47	20,117.18
其中：基金申购款	27,790.20	-2,077.26	25,712.94
基金赎回款	-6,076.55	480.79	-5,595.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,867.82	-1,909.85	38,957.97

博时双季享持有期债券 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	3,046,061.55	-864,719.97	2,181,341.58

本期利润	933,355.39	664,187.47	1,597,542.86
本期基金份额交易产生的变动数	-156,235.82	18,625.70	-137,610.12
其中：基金申购款	1,056,780.82	-145,053.39	911,727.43
基金赎回款	-1,213,016.64	163,679.09	-1,049,337.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,823,181.12	-181,906.80	3,641,274.32

6.4.3.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	3,895.57
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	2,285.84
其他	8.70
合计	6,190.11

6.4.3.11 股票投资收益

无发生额。

6.4.3.12 债券投资收益

6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,385,568.10
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	313,686.93
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	1,699,255.03

6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	93,559,254.72
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	92,031,234.18

减：应计利息总额	1,209,986.11
减：交易费用	4,347.50
买卖债券差价收入	313,686.93

6.4.3.13 资产支持证券投资收益

6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.3.13.2 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。

6.4.3.14 衍生工具收益

6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

6.4.3.15 股利收益

无发生额。

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	815,521.11
——股票投资	-
——债券投资	815,521.11
——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	815,521.11

6.4.3.17 其他收入

无发生额。

6.4.3.18 信用减值损失

无。

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
上交所账户维护费	9,450.00
中债登账户维护费	9,000.00
银行汇划费	3,320.62
合计	101,113.78

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明
6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 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。

6.4.5 关联方关系
6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	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
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.6.2 关联方报酬
6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年	2022 年 1 月 1 日至 2022 年

	6 月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	89,124.55	168,528.73
其中：支付销售机构的客户维护费	36,450.10	77,792.75

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 0.30% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	14,854.10	28,088.10

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

6.4.6.2.3 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	博时双季享持有期 债券 A	博时双季享持有 期债券 B	博时双季享持有期 债券 C	合计
中信银行	-	47.61	50,827.08	50,874.69
博时基金	-	111.21	6,414.14	6,525.35
合计	-	158.82	57,241.22	57,400.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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			
	博时双季享持有期 债券 A	博时双季享持有 期债券 B	博时双季享持有期 债券 C	合计
中信银行	-	394.98	142,222.75	142,617.73
博时基金	-	79.98	127.52	207.50
合计	-	474.96	142,350.27	142,825.23

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 B 类基金份额和 C 类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，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。B 类基金份额和 C 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.30% 和 0.35%。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 B/C 类基金份额的基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 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

6.4.6.4.1 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。

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 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。

6.4.6.6 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
中信银行-活期存款	1,934,392.73	3,895.57	1,666,009.53	8,385.70

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。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 13,094,579.05 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
102281278	22 阜阳投资 MTN001	2023-07-05	100.17	40,000.00	4,006,644.37
102380244	23 中冶 MTN004	2023-07-05	102.18	30,000.00	3,065,488.77
092280139	22 交行二级 资本债 02A	2023-07-05	101.38	30,000.00	3,041,525.10
102101188	21 鲁黄金 MTN003	2023-07-05	101.30	20,000.00	2,025,901.64
102101528	21 首钢 MTN002B	2023-07-05	105.23	18,000.00	1,894,152.43
合计				138,000.00	14,033,712.31

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。

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严格控制投资组合风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。

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。

6.4.9.2 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主要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。

6.4.9.2.1 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 2023 年 6 月 30 日	上年末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	14,348,667.24	14,327,423.57
合计	14,348,667.24	14,327,423.57

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。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.2.4 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 2023 年 6 月 30 日	上年末 2022 年 12 月 31 日
AAA	28,554,129.13	20,091,094.35
AAA 以下	5,200,847.12	20,506,432.87
未评级	23,585,261.48	25,055,007.55
合计	57,340,237.73	65,652,534.77

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。

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.3 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约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。

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	1,934,392.73	-	-	-	1,934,392.73
结算备付金	27,548.52	-	-	-	27,548.52

存出保证金	898.83	-	-	-	898.83
交易性金融资产	21,575,416.00	39,684,376.95	10,429,112.02	-	71,688,904.97
应收清算款	-	-	-	3,701,915.89	3,701,915.89
买入返售金融资产	-1,277.26	-	-	-	-1,277.26
应收申购款	-	-	-	72,347.59	72,347.59
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	23,536,978.82	39,684,376.95	10,429,112.02	3,774,263.48	77,424,731.27
负债					
卖出回购金融资产款	13,094,579.05	-	-	-	13,094,579.05
应付赎回款	-	-	-	145,928.16	145,928.16
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	15,259.16	15,259.16
应付托管费	-	-	-	2,543.19	2,543.19
应付销售服务费	-	-	-	13,523.63	13,523.63
应交税费	-	-	-	7,713.49	7,713.49
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	94,403.26	94,403.26
负债总计	13,094,579.05	-	-	279,370.89	13,373,949.94
利率敏感度缺口	10,442,399.77	39,684,376.95	10,429,112.02	3,494,892.59	64,050,781.33
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	644,765.85	-	-	-	644,765.85
结算备付金	140,040.70	-	-	-	140,040.70
存出保证金	1,365.74	-	-	-	1,365.74
交易性金融资产	34,833,856.44	33,018,889.75	12,127,212.15	-	79,979,958.34
应收清算款	-	-	-	199,237.04	199,237.04

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	10,237.88	10,237.88
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	35,620,028.73	33,018,889.75	12,127,212.15	209,474.92	80,975,605.55
负债					
卖出回购金融资产款	19,558,789.90	-	-	-	19,558,789.90
应付赎回款	-	-	-	150,510.80	150,510.80
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	16,060.70	16,060.70
应付托管费	-	-	-	2,676.78	2,676.78
应付销售服务费	-	-	-	15,027.98	15,027.98
应交税费	-	-	-	5,523.23	5,523.23
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	75,402.53	75,402.53
负债总计	19,558,789.90	-	-	265,202.02	19,823,991.92
利率敏感度缺口	16,061,238.83	33,018,889.75	12,127,212.15	-55,727.10	61,151,613.63

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。

6.4.9.4.1.2 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 71	减少约 65
市场利率下降 25 个基点	增加约 75	增加约 68	

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.3 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。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 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 2023年6月30日
第一层次	-
第二层次	71,688,904.97
第三层次	-
合计	71,688,904.97

6.4.10.2.2 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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	71,688,904.97	92.59
	其中：债券	71,688,904.97	92.59
	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	-1,277.26	0.00
	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	1,961,941.25	2.53
8	其他各项资产	3,775,162.31	4.88
9	合计	77,424,731.27	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

无。

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

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

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	13,686,644.51	21.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,168,316.88	8.07
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	18,224,914.30	28.45
5	企业短期融资券	9,058,477.76	14.14
6	中期票据	25,550,551.52	39.89
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	71,688,904.97	111.93

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	230009	23 付息国债 09	100,000	10,429,112.02	16.28
2	102002051	20 淮南建发 MTN003	50,000	5,200,847.12	8.12
3	137673	22 红狮 01	40,000	4,091,482.74	6.39
4	149888	22 鲲鹏 02	40,000	4,043,996.71	6.31
5	185783	22 陕煤 Y3	40,000	4,039,941.26	6.31

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的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内受到公开谴责、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	898.83
2	应收清算款	3,701,915.89
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	72,347.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	3,775,162.31
---	----	--------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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
博时双季享持有期债券 A	2,144	6,813.18	2,200,288.05	15.06%	12,407,178.76	84.94%
博时双季享持有期债券 B	49	9,417.64	94.75	0.02%	461,369.62	99.98%
博时双季享持有期债券 C	1,059,541	41.47	3,817,617.29	8.69%	40,122,456.44	91.31%
合计	1,061,686	55.58	6,018,000.09	10.20%	52,991,004.82	89.80%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时双季享持有期债券 A	9,763.38	0.07%
	博时双季享持有期债券 B	9.42	0.00%

	博时双季享持有期债券 C	11.27	0.00%
	合计	9,784.07	0.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时双季享持有期债券 A	博时双季享持有期债券 B	博时双季享持有期债券 C
基金合同生效日（2020年10月13日）基金份额总额	95,190,712.26	1,153,592.85	1,255,999,841.28
本报告期期初基金份额总额	11,611,353.91	191,706.44	46,518,891.54
本报告期基金总申购份额	5,535,860.50	346,899.00	14,296,205.61
减：本报告期基金总赎回份额	2,539,747.60	77,141.07	16,875,023.42
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	14,607,466.81	461,464.37	43,940,073.73

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，邵凯先生离任公司副总经理，继续担任公司投资决策委员会委员。

基金管理人于 2023 年 5 月 27 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，孙献离任公司财务负责人；吴慧峰任公司副总经理、财务负责人。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到董事长、非执行董事朱鹤新先生的辞呈。董事会选举本行党委书记、副董事长、董事方合英先生为本行董事长，将自中国银行业监管机构核准其董事长任职资格之日起正式就任。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到本行行长方合英先生的辞呈。董事会聘任本行党委副书记、董事、常务副行长刘成先生为本行行长，将自中国银行业监管机构核准其行长任职资格之日起正式就任。

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，聘请普华永道中天会计师事务所（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

10.6.1 管理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的稽查或处罚。

10.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
长江证券	2	-	-	-	-	-

兴业证券	2	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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；能根据基金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
长江证券	9,934,463.61	100.00%	250,350,000.00	100.00%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

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-20230601	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01
2	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-27
3	博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金（博时双季享持有期债券 A）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	2023-04-26
4	博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金（博时双季享持有期债券 B）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	2023-04-26
5	博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金（博时双季享持有期债券 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	2023-04-26

6	博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-25
7	博时基金管理有限公司关于博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金的基金经理变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-25
8	博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-22
9	博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金 2022 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-30
10	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-18
11	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通兴业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	2023-02-13
12	博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-20
13	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-20230104	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-04

§ 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

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金基金合同》

- 3、《博时双季享六个月持有期债券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、博时双季享六个月持有期债券型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时双季享六个月持有期债券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
二〇二三年八月三十一日