
博远优享混合型证券投资基金

2023年第3季度报告

2023年09月30日

基金管理人:博远基金管理有限公司

基金托管人:宁波银行股份有限公司

报告送出日期:2023年10月25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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年10月24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2023年7月1日起至2023年9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称 | 博远优享混合 |
| 基金主代码 | 010906 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021年03月30日 |
| 报告期末基金份额总额 | 48,082,202.36份 |
| 投资目标 | 本基金在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。 |
| 投资策略 | <p>(1) 大类资产配置策略，本基金基于跟踪研究宏观经济走势和宏观经济政策动向等因素变化情况，采取自上而下的分析方法，对各类资产进行合理配置；</p> <p>(2) 股票投资方面，本基金采取行业配置策略和个股精选策略相结合的投资方法，寻找具有投资潜力的细分行业和个股；</p> <p>(3) 债券投资方面，本基金以长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、息差策略和信用债投资策略等多种积极管理策略，深入研究挖掘价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合；</p> <p>(4) 其他金融工具投资方面，</p> |

| | | |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------|---------------|
| | 将根据不同市场环境下，不同金融工具的投资收益风险匹配情况，适当参与投资，在保持投资组合良好流动性的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。 | |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深300指数收益率×15%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5% | |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 博远基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 宁波银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 博远优享混合A | 博远优享混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 010906 | 010907 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 44,503,331.63份 | 3,578,870.73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(2023年07月01日 - 2023年09月30日) | |
|----------------|--------------------------------|--------------|
| | 博远优享混合A | 博远优享混合C |
| 1.本期已实现收益 | 72,517.39 | 6,625.36 |
| 2.本期利润 | -1,188,843.74 | -70,374.08 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0262 | -0.0125 |
| 4.期末基金资产净值 | 40,174,994.90 | 3,198,029.48 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9027 | 0.8936 |

注：1、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。

2、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 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

博远优享混合A净值表现

| 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 | -2.84% | 0.27% | -0.56% | 0.13% | -2.28% | 0.14% |
| 过去六个月 | -2.16% | 0.31% | -0.58% | 0.12% | -1.58% | 0.19% |
| 过去一年 | -3.60% | 0.32% | 0.21% | 0.14% | -3.81% | 0.18% |
| 自基金合同生效起至今 | -9.73% | 0.34% | -1.27% | 0.16% | -8.46% | 0.18% |

博远优享混合C净值表现

| 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 | -2.93% | 0.28% | -0.56% | 0.13% | -2.37% | 0.15% |
| 过去六个月 | -2.35% | 0.31% | -0.58% | 0.12% | -1.77% | 0.19% |
| 过去一年 | -3.98% | 0.32% | 0.21% | 0.14% | -4.19% | 0.18% |
| 自基金合同生效起至今 | -10.64% | 0.34% | -1.27% | 0.16% | -9.37% | 0.18% |

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

博远优享混合A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03月30日-2023年09月30日)



博远优享混合C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03月30日-2023年09月30日)



注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。本基金建仓期已结束，建仓期结束时，本基金的各项投资组合比例符合基金合同的约定。

§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 | | |
| 黄军锋 | 公司副总经理、本基金基金经理 | 2023-03-27 | - | 21年 | 黄军锋先生，中国国籍，毕业于北京大学，硕士研究生。现任博远基金管理有限公司副总经理。历任渤海证券股份有限公司研究所研究员、泰康资产管理有限责任公司权益投资部研究员、中国金融期货交易所监查部执行经理、合众资产管理股份有限公司任金融工程部总经理。2023年3月27日起任博远优享混合型证券投资基金基金经理。 |

- 注：1、基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日。
 2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。
 3、本基金基金经理报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、监管规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，基金管理人制定了《博远基金管理有限公司投资组合公平交易管理制度》及《博远基金管理有限公司投资组合异常交易监控与报告制度》。基金管理人旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部门负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，集中交易室负责交易执行，风险监察部

负责事前提醒、事中跟进、事后检查并对交易情况进行合理性分析，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为，本基金管理人管理的所有投资组合不存在组合内及组合间的同日反向交易，在不同时间窗口下相邻交易日（1日内、3日内、5日内）的同向交易及反向交易均未出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023年三季度，随着稳增长政策的逐渐落地，中国经济增长企稳回暖。9月中国制造业PMI升至50.2，较上月上升0.5%，重返扩张区间。这是制造业PMI自今年4月以来首次升至扩张区间，也是连续第四个月回升。8月社会消费品零售总额同比增长4.6%，增速比上月加快2.1%；规模以上工业增加值同比增长4.5%，增速比上月加快0.8%。此外，8月新增信贷、社融数据均超机构普遍预期，物价数据有触底反弹迹象。中秋国庆长假消费数据也保持稳健复苏。

国内债券市场三季度大幅震荡，10年期国债收益率在8月下旬创出三年多的新低2.538%，随后快速回升。股票市场继续下跌，二季度上证指数下跌2.86%，深证成指下跌8.32%，沪深300指数下跌3.98%。

本季度本基金的债券投资维持较低仓位，主要配置于高等级与中短组合久期的信用债，静待更好投资机会。股票和可转债方面，配置品种以数字经济、新能源和受益于经济复苏的行业龙头为主。

展望下一阶段，最欠缺的仍然是信心。国内稳增长政策的持续发力，将推动宏观经济逐渐回升向好，市场流动性宽松的局面不会改变，优质上市公司经过连续两个季度调整以后，估值水平很有吸引力，对权益市场适度乐观的同时也要保持耐心。配置思路上，数字经济仍可能成为贯穿全年的主线；供给侧结构持续优化、行业景气度有望反转的优质个股可能会有较好的投资机会。债券市场方面，收益率水平低，稳增长政策可能带来调整压力，投资保持适度谨慎。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末博远优享混合A基金份额净值为0.9027元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.84%，同期业绩比较基准收益率为-0.56%；截至报告期末博远优享混合C基金份额净值为0.8936元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.93%，同期业绩比较基准收益率为-0.56%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；本基金出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§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 | 10,302,801.16 | 23.68 |
| | 其中：股票 | 10,302,801.16 | 23.68 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 29,386,728.15 | 67.54 |
| | 其中：债券 | 29,386,728.15 | 67.54 |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 3,629,303.64 | 8.34 |
| 8 | 其他资产 | 188,644.05 | 0.43 |
| 9 | 合计 | 43,507,477.00 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | 189,450.00 | 0.44 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 3,772,635.16 | 8.70 |
| D | 电力、热力、燃气及水 生产和供应业 | 333,600.00 | 0.77 |
| E | 建筑业 | 1,713,600.00 | 3.95 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政 业 | 1,052,700.00 | 2.43 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,784,816.00 | 6.42 |
| J | 金融业 | 456,000.00 | 1.05 |
| 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 | 10,302,801.16 | 23.75 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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 | 600941 | 中国移动 | 15,000 | 1,452,300.00 | 3.35 |
| 2 | 600050 | 中国联通 | 200,000 | 982,000.00 | 2.26 |
| 3 | 000032 | 深桑达 A | 40,000 | 895,200.00 | 2.06 |
| 4 | 601390 | 中国中铁 | 120,000 | 818,400.00 | 1.89 |
| 5 | 300274 | 阳光电源 | 8,000 | 716,080.00 | 1.65 |
| 6 | 002352 | 顺丰控股 | 17,000 | 693,600.00 | 1.60 |
| 7 | 002271 | 东方雨虹 | 25,000 | 667,000.00 | 1.54 |
| 8 | 600426 | 华鲁恒升 | 17,000 | 545,700.00 | 1.26 |
| 9 | 300059 | 东方财富 | 30,000 | 456,000.00 | 1.05 |
| 10 | 600309 | 万华化学 | 5,000 | 441,600.00 | 1.02 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 17,634,933.83 | 40.66 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 8,201,704.02 | 18.91 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 3,550,090.30 | 8.19 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 29,386,728.15 | 67.75 |

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 | 149285 | 20深铁06 | 43,000 | 4,415,685.79 | 10.18 |
| 2 | 102103360 | 21陕煤化MTN012 | 40,000 | 4,115,511.23 | 9.49 |
| 3 | 102000470 | 20中石油MTN003 | 40,000 | 4,086,192.79 | 9.42 |
| 4 | 127863 | 18苏交04 | 39,000 | 4,033,406.50 | 9.30 |
| 5 | 127470 | G17龙湖3 | 31,000 | 3,025,764.94 | 6.98 |

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

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

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 本报告期内，本基金投资的前十名证券除21陕煤化MTN012（102103360.IB）、20中石油MTN003（102000470.IB）和20深铁06（149285.SZ）的发行主体外，没有出现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。

本基金投资的前十名证券之一的21陕煤化MTN012（102103360.IB）发行主体陕西煤业化工集团有限责任公司因违反支付结算、反洗钱、货币金银、国库、金融消费者权益保护及征信管理规定等事项，于2022年10月31日受到中国人民银行西安分行处罚（西银罚决字（2022）1号）。

本基金投资的前十名证券之一的20中石油MTN003（102000470.IB）发行主体中国石油天然气集团有限公司分支机构中国石油天然气集团有限公司冀东商业储备油库分公司因安全生产危险化学品类违法事项，于2023年3月7日受到唐山市应急管理局（[冀唐]应急罚[2023]危化007号）。

本基金投资的前十名证券之一的20深铁06（149285.SZ）发行主体深圳市地铁集团有限公司因未依法履行职责，受到深圳市交通运输局罚款2.00万元（文号：深交罚决第（2022）ZD19088号）。

本基金管理人认为，以上处罚不会对其投资价值构成实质性影响。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 188,644.05 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 188,644.05 |

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 | 113024 | 核建转债 | 1,835,333.70 | 4.23 |
|---|--------|------|--------------|------|

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

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | 博远优享混合A | 博远优享混合C |
|-------------------------------|---------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 45,928,482.50 | 4,057,514.72 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 53,966.72 | 5,446,576.32 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 1,479,117.59 | 5,925,220.31 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 44,503,331.63 | 3,578,870.73 |

注：总申购份额含红利再投（如有）、转换入份额（如有），总赎回份额含转换出份额（如有）。

§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

| | 博远优享混合A | 博远优享混合C |
|--------------------------|---------------|---------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,000,000.00 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 10,000,000.00 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 20.80 | - |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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 | 20230701-20230930 | 10,000,000.00 | 0.00 | 0.00 | 10,000,000.00 | 20.80% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>(1) 不能及时应对赎回的风险</p> <p>持有份额比例较高的基金份额持有人（以下简称“高比例投资者”）大额赎回时，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险</p> <p>当高比例投资者大量赎回时，基金管理人为支付赎回款项而变现基金资产，可能造成资产价格波动，导致本基金资产净值发生波动。若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。若高比例投资者大量赎回本基金，计算基金份额净值时进行四舍五入也可能引起基金份额净值发生波动。</p> <p>(3) 基金规模较小导致的风险</p> <p>高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。</p> <p>(4) 基金面临转型、合并或提前终止的风险</p> <p>高比例投资者赎回后，可能会导致出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。</p> | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准博远优享混合型证券投资基金注册的文件；
- 2、《博远优享混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博远优享混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《博远优享混合型证券投资基金招募说明书》及其更新；
- 5、博远基金管理有限公司业务资格批准文件、营业执照；
- 6、本报告期内本基金在符合中国证监会规定条件的全国性报刊上披露的各项公告原件。

9.2 存放地点

深圳市福田区皇岗路5001号深业上城T2栋4301室博远基金管理有限公司

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人住所免费查询，或登录中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund/>）及基金管理人网站（<http://www.boyuanfunds.com>）查阅。

博远基金管理有限公司

2023年10月25日