

# 博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 06 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

送出日期:2021 年 08 月 27 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月26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2021年01月01日起至2021年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	19
§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	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46
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	46
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	46
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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情况	49

§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
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.....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金		
基金简称	博远鑫享三个月债券		
基金主代码	010096		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020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		
报告期末基金份额总额	108,452,266.46份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	博远鑫享三个月 债券A	博远鑫享三个月 债券C	博远鑫享三个月 债券E
下属分级基金的交易代码	010096	010097	010098
报告期末下属分级基金的 份额总额	63,912,349.87份	37,104,742.63份	7,435,173.96份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资债券资产，辅助其他资产配置增厚收益，在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，力争获取超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金以大类资产配置策略为指导实时调整债券、股票、货币市场工具和国债期货等资产配置比例。（1）债券投资策略，本基金将在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。其中，宏观环境分析通过跟踪宏观环境变化对投资组合类属资产进行优化配置和调整，微观市场定价分析则采用久期调整策略、收益率曲线配置策略、息差策略和信用债投资策略等积极投资策略增强债券投资收益；（2）可转换债券及可交换债券投资策略，本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券和可交换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估

	值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有；（3）资产支持证券投资策略，本基金通过对影响资产支持证券风险收益的因素进行分析，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置；（4）股票投资策略，本基金可适度参与股票市场投资，主要采取定性分析和定量分析相结合的方式，精选基本面优质，具有长期投资价值的个股，增强基金资产收益；（5）国债期货投资策略，本基金参与国债期货的投资以套期保值为目的。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金是债券型基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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		博远基金管理有限公司	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	朱广科
	联系电话	0755-29395888	0574-87050338
	电子邮箱	compliance@boyuanfunds.com	custody-audit@nbc.cn
客户服务电话		0755-29395858	0574-83895886
传真		0755-29395889	0574-89103213
注册地址		深圳市福田区皇岗路5001号深业上城T2栋4301室	中国浙江宁波市鄞州区宁东路345号
办公地址		深圳市福田区皇岗路5001号深业上城T2栋4301室	中国浙江宁波市鄞州区宁东路345号
邮政编码		518000	315100
法定代表人		钟鸣远	陆华裕

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
----------------	------

登载基金中期报告正文的 管理人互联网网址	www.boyuanfunds.com
基金中期报告备置地点	深圳市福田区皇岗路5001号深业上城T2栋4301室

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博远基金管理有限公司	深圳市福田区皇岗路5001号深业上城T2栋4301

## §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 (2021年01月01日-2021年06月30日)		
	博远鑫享三 个月债券A	博远鑫享三 个月 债券C	博远鑫享三 个月 债券E
本期已实现收益	4,242,088.94	960,122.71	1,683,416.38
本期利润	2,426,551.91	678,486.23	662,576.29
加权平均基金份额本期利 润	0.0368	0.0239	0.0493
本期加权平均净值利润率	3.51%	2.28%	4.73%
本期基金份额净值增长率	3.31%	3.10%	3.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)		
期末可供分配利润	3,683,390.48	2,018,278.12	428,698.03
期末可供分配基金份额利 润	0.0576	0.0544	0.0577
期末基金资产净值	67,595,740.35	39,123,020.75	7,863,871.99
期末基金份额净值	1.0576	1.0544	1.0577
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)		
基金份额累计净值增长率	5.76%	5.44%	5.77%

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、期末可供分配利润，为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。

### 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

##### 博远鑫享三个月债券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	0.00%	0.16%	-0.24%	0.09%	0.24%	0.07%
过去三个月	1.09%	0.12%	0.77%	0.10%	0.32%	0.02%
过去六个月	3.31%	0.20%	0.70%	0.14%	2.61%	0.06%
自基金合同生效起至今	5.76%	0.19%	2.56%	0.13%	3.20%	0.06%

##### 博远鑫享三个月债券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	-0.03%	0.16%	-0.24%	0.09%	0.21%	0.07%
过去三个月	1.00%	0.12%	0.77%	0.10%	0.23%	0.02%
过去六个月	3.10%	0.20%	0.70%	0.14%	2.40%	0.06%
自基金合同生效起至今	5.44%	0.19%	2.56%	0.13%	2.88%	0.06%

##### 博远鑫享三个月债券E

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	0.00%	0.15%	-0.24%	0.09%	0.24%	0.06%
过去三个月	1.10%	0.12%	0.77%	0.10%	0.33%	0.02%

过去六个月	3.32%	0.20%	0.70%	0.14%	2.62%	0.06%
自基金合同生效起至今	5.77%	0.19%	2.56%	0.13%	3.21%	0.06%

注：截至报告期末，本基金合同生效时间（2020年9月30日）未满一年。

### 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

博远鑫享三个月债券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



博远鑫享三个月债券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



博远鑫享三个月债券E累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：截至报告期末，本基金合同生效时间（2020年9月30日）未满一年。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

博远基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会证监许可【2018】1920号文批准，于2018年12月12日在深圳注册成立，注册资本1亿元人民币，并于2019年7月1日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。公司目前股东及其出资比例为：钟鸣远先生45.03%，深圳博远协创投资中心（有限合伙）40%，胡隽先生4.99%，黄军锋先生4.99%，姜俊先生4.99%。截止本报告期末，本基金管理人共管理了5只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
钟鸣远	公司总经理、本基金基金经理	2020-09-30	-	24年	钟鸣远先生，中国国籍，董事，毕业于复旦大学金融学专业，经济学硕士学位，具有基金从业资格。现任博远基金管理有限公司总经理。历任国家开发银行深圳分行资金计划部职员，联合证券有限责任公司固定收益部投资经理，泰康人寿保险股份有限公司固定收益策略研究员，新华资产管理股份有限公司固定收益部高级投资经理，易方达基金管理有限公司固定收益总部总经理兼固定收益投资部总经理，大成基金管理有限

					公司副总经理。2019年11月19日起任博远增强回报债券型证券投资基金基金经理。2020年4月15日起兼任博远双债增利混合型证券投资基金基金经理。2020年7月8日起兼任博远博锐混合型发起式证券投资基金基金经理。2020年9月30日起兼任博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金基金经理。2021年3月30日起兼任博远优享混合型证券投资基金基金经理。
余丽旋	本基金基金经理	2020-10-26	-	10年	余丽旋女士，中国国籍，中国人民大学管理学学士，具有基金从业资格，中国注册会计师（CPA）非执业会员。曾任职于易方达基金管理有限公司、深圳市万杉资本管理有限公司。2019年4月加入博远基金管理有限公司，现任固定收益投资总部部门负责人兼基金经理。2020年10月26日起任博远鑫享三个月持有期债券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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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合规守信情况的说明

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 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

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 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

今年上半年，经济呈现继续温和复苏态势，但在二季度有一定边际趋缓。一季度在去年疫情低基数效应下，经济数据呈现高速增长。一季度工业生产继续维持近期的高速增长状态，外需以及国内经济动能贡献较大，出口和房地产依旧较为坚挺。但在二季度以来，推动疫后中国经济快速恢复的出口和房地产投资，增速有放缓迹象。制造业和消费处于缓慢修复中，控制宏观杠杆率和隐性债务治理下的基建投资也远不及预期。从生产端看，出口景气度减弱，加上“缺芯”、电力供应不足、停产限产和安全检查的影响，二季度工业企业生产强度弱于一季度。

债券方面，虽然受通胀预期约束，但市场仍在社融增速下行、地产融资受到遏制、地方债发行不及预期、机构配置力量较强、资金面较为平稳等诸多利多因素下，呈现震荡格局。十年国债收益率下行7bp，十年国开债收益率下行5bp。

权益市场方面，在高估值下波动加快，板块轮动加快。春节前主要是业绩确定性较强的价值股表现亮眼，春节后由于海内外通胀预期影响，担心流动性收缩，市场经历剧烈波动。逐步国内外流动性表现较为温和，以新能源汽车、医美、半导体等高景气高成长的细分赛道表现较好，而消费、医药等板块由于基本面或政策压制担忧受到一定抑制。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，博远鑫享三个月债券A基金份额净值为1.0576元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.31%，同期业绩比较基准收益率为0.70%；截至报告期末，博远鑫享三个月债券C基金份额净值为1.0544元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.10%，同期业绩比较基准收益率为0.70%；截至报告期末，博远鑫享三个月债券E基金份额净值为1.0577元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.32%，同期业绩比较基准收益率为0.70%。

#### 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，市场所担心的利率债供给压力仍然存在，仍需警惕利率债供给放量对市场的影响。但由于地产和地方政府融资平台的融资需求受到一些限制，预计机构配置力量仍较强。本基金以配置2年久期左右高等级信用债为主，关注利率债的交易性机会。股票市场方面，景气度较高板块的估值偏高，一定程度透支未来盈利。组合配置上将更加注重结构性机会和均衡配置，优选收益风险比较高的标的，同时密切关注市场流动性的边际变化。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司基金运营部总经理担任估值委员会主席，权益投资总部、固定收益投资总部、研究部、风险监察部和基金运营部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。

本报告期内，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，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和交易所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

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 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

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或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### §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，本托管人在博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### §6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	2,122,100.02	26,136,022.99
结算备付金		-	-
存出保证金		1,260,730.46	19,608,667.32
交易性金融资产	6.4.7.2	122,948,965.74	130,976,195.69
其中：股票投资		12,576,735.88	34,105,165.72
基金投资		-	-
债券投资		110,372,229.86	96,871,029.97
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.3	-	60,008,270.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.4	1,224,035.94	1,087,755.74
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		127,555,832.16	237,816,911.74
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		12,499,851.25	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		306,151.94	17,537,915.31
应付管理人报酬		38,613.48	75,084.19
应付托管费		9,653.35	18,771.03
应付销售服务费		13,042.59	10,633.46

应付交易费用	6.4.7.6	13,811.22	18,503.17
应交税费		8,382.05	9,850.86
应付利息		1,870.33	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	81,822.86	71,687.63
负债合计		12,973,199.07	17,742,445.65
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.8	108,452,266.46	215,001,636.55
未分配利润	6.4.7.9	6,130,366.63	5,072,829.54
所有者权益合计		114,582,633.09	220,074,466.09
负债和所有者权益总计		127,555,832.16	237,816,911.74

注:报告截止日2021年06月30日, 基金份额总额108,452,266.46份, 其中博远鑫享三个月债券A基金份额63,912,349.87份, 基金份额净值1.0576元; 博远鑫享三个月债券C基金份额37,104,742.63份, 基金份额净值1.0544元; 博远鑫享三个月债券E基金份额7,435,173.96份, 基金份额净值1.0577元。

## 6.2 利润表

会计主体: 博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金

本报告期: 2021年01月01日至2021年06月30日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至2021年0 6月30日
<b>一、收入</b>		4,521,473.35
1.利息收入		1,594,097.23
其中: 存款利息收入	6.4.7.10	42,306.50
债券利息收入		1,516,351.80
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		35,438.93
其他利息收入		-

2.投资收益（损失以“-”填列）		6,032,854.12
其中：股票投资收益	6.4.7.11	5,266,222.44
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	706,204.68
资产支持证券投资收益	6.4.7.12.3	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	60,427.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-3,118,013.60
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	12,535.60
<b>减：二、费用</b>		753,858.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	225,823.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	56,455.92
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	58,750.61
4. 交易费用	6.4.7.17	214,414.29
5. 利息支出		96,945.18
其中：卖出回购金融资产支出		96,945.18
6. 税金及附加		4,146.08
7. 其他费用	6.4.7.18	97,322.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,767,614.43
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		3,767,614.43

注:本基金合同于2020年9月30日生效,上年度可比区间无比较数据,因此利润表只列示2021年1月1日至2021年6月30日数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	215,001,636.55	5,072,829.54	220,074,466.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,767,614.43	3,767,614.43
三、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)	-106,549,370.09	-2,710,077.34	-109,259,447.43
其中：1.基金申购款	45,292,866.36	1,996,685.67	47,289,552.03
2.基金赎回款	-151,842,236.45	-4,706,763.01	-156,548,999.46
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	108,452,266.46	6,130,366.63	114,582,633.09

注:本基金合同于2020年9月30日生效,上年度可比区间无比较数据,因此所有者权益变动表只列示2021年1月1日至2021年6月30日数据。

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:

钟鸣远

姜俊

韩晓燕

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2020]1774号《关于准予博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金注册的批复》注册,由博远基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集218,384,868.65元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0854号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》于2020年9月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为218,414,776.76份基金份额,其中认购资金利息折合29,908.11份基金份额。本基金的基金管理人为博远基金管理有限公司,基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据《博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》和《博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购费用、申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为博远鑫享三个月债券A;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,根据销售服务费费率设置的不同,分别称为博远鑫享三个月债券C和博远鑫享三个月债券E。博远鑫享三个月债券A、博远鑫享三个月债券C和博远鑫享三个月债券E分别设置代码,分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但本基金不同基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括债券(含国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券等)、国内依法发行上市的股票及存托凭证(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票以及存托凭证)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为:本基金债券资产的投资比例不低于基金资产的80%;股票及存托凭证资产的投资比例为基金资产的0-20%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率 $\times$ 90%+沪深300指数收益率 $\times$ 10%。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》和其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

## 6.4.4 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、会计估计与最近一年年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 差错更正的说明

本基金在本报告期无会计差错。

## 6.4.6 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[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	2,122,100.02
定期存款	-
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	-
合计	2,122,100.02

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		12,299,591.00	12,576,735.88	277,144.88
贵金属投资-金交所 黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	29,931,480.36	29,954,229.86	22,749.50
	银行间市场	80,101,578.65	80,418,000.00	316,421.35
	合计	110,033,059.01	110,372,229.86	339,170.85
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		122,332,650.01	122,948,965.74	616,315.73

**6.4.7.3 买入返售金融资产**

无。

**6.4.7.4 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	1,407.63
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	1,222,487.51
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	140.80

合计	1,224,035.94
----	--------------

注：“其他”为应收券商结算保证金利息。

#### 6.4.7.5 其他资产

无。

#### 6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	13,811.22
合计	13,811.22

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用-审计费	22,315.49
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	81,822.86

#### 6.4.7.8 实收基金

##### 6.4.7.8.1 博远鑫享三个月债券A

金额单位：人民币元

项目 (博远鑫享三个月债券A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	103,970,911.20	103,970,911.20
本期申购	12,563,260.60	12,563,260.60
本期赎回(以“-”号填列)	-52,621,821.93	-52,621,821.93

本期末	63,912,349.87	63,912,349.87
-----	---------------	---------------

#### 6.4.7.8.2 博远鑫享三个月债券C

金额单位：人民币元

项目 (博远鑫享三个月债券C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,350,132.84	18,350,132.84
本期申购	28,005,940.20	28,005,940.20
本期赎回（以“-”号填列）	-9,251,330.41	-9,251,330.41
本期末	37,104,742.63	37,104,742.63

#### 6.4.7.8.3 博远鑫享三个月债券E

金额单位：人民币元

项目 (博远鑫享三个月债券E)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	92,680,592.51	92,680,592.51
本期申购	4,723,665.56	4,723,665.56
本期赎回（以“-”号填列）	-89,969,084.11	-89,969,084.11
本期末	7,435,173.96	7,435,173.96

注：1、申购含红利再投(如有)、转换入份额(如有)，赎回含转换出份额(如有)。

2、根据《博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》、《博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金招募说明书》及《博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告》的相关规定，本基金的最短持有期限为3个月。对于本基金每份基金份额，最短持有期指基金合同生效日（对认购份额而言）、基金份额申购确认日（对申购份额而言）或基金份额转换转入确认日（对转换转入份额而言）起，至基金合同生效日、基金份额申购确认日及基金份额转换转入确认日次3个月的月度对日的前一日（即最短持有期到期日）止的期间。本基金日常申购（转换转入、定期定额投资）业务自2020年12月23日起开始办理，赎回（转换转出）业务自2020年12月30日起开始办理。

#### 6.4.7.9 未分配利润

**6.4.7.9.1 博远鑫享三个月债券A**

单位：人民币元

项目 (博远鑫享三个月债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	699,519.01	1,764,341.71	2,463,860.72
本期利润	4,242,088.94	-1,815,537.03	2,426,551.91
本期基金份额交易产生的变动数	-783,115.88	-423,906.27	-1,207,022.15
其中：基金申购款	533,555.14	-27,816.33	505,738.81
基金赎回款	-1,316,671.02	-396,089.94	-1,712,760.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,158,492.07	-475,101.59	3,683,390.48

**6.4.7.9.2 博远鑫享三个月债券C**

单位：人民币元

项目 (博远鑫享三个月债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	104,719.51	311,111.41	415,830.92
本期利润	960,122.71	-281,636.48	678,486.23
本期基金份额交易产生的变动数	1,228,726.36	-304,765.39	923,960.97
其中：基金申购款	1,445,116.89	-230,504.47	1,214,612.42
基金赎回款	-216,390.53	-74,260.92	-290,651.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,293,568.58	-275,290.46	2,018,278.12

**6.4.7.9.3 博远鑫享三个月债券E**

单位：人民币元

项目 (博远鑫享三个月债券E)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	620,430.61	1,572,707.29	2,193,137.90
本期利润	1,683,416.38	-1,020,840.09	662,576.29

本期基金份额交易产生的变动数	-1,819,854.35	-607,161.81	-2,427,016.16
其中：基金申购款	290,236.80	-13,902.36	276,334.44
基金赎回款	-2,110,091.15	-593,259.45	-2,703,350.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	483,992.64	-55,294.61	428,698.03

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
活期存款利息收入	35,814.25	
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	-	
其他	6,492.25	
合计	42,306.50	

注：其中“其他”为券商结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
卖出股票成交总额	85,230,730.00	
减：卖出股票成本总额	79,964,507.56	
买卖股票差价收入	5,266,222.44	

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	706,204.68
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	706,204.68

#### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	222,981,331.90
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	218,847,080.03
减：应收利息总额	3,428,047.19
买卖债券差价收入	706,204.68

#### 6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	60,427.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	60,427.00

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1.交易性金融资产	-3,118,013.60
——股票投资	-3,022,937.84
——债券投资	-95,075.76
——资产支持证券投资	-
——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	-3,118,013.60

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	12,535.60
合计	12,535.60

注：1、本基金赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。  
2、基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	207,789.29
银行间市场交易费用	6,625.00

合计	214,414.29
----	------------

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
账户维护费-中债登	7,500.00
其他	200.00
账户维护费-上清所	7,800.00
合计	97,322.86

注：“其他”为上清所查询服务费。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

本基金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。

##### 6.4.9.2 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
博远基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
宁波银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.5 基金交易

无。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	225,823.98
其中：支付销售机构的客户维护费	26,987.64

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.40%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

2、客户维护费是指基金管理人及基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	56,455.92

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

**6.4.10.2.3 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			
	2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	博远鑫享三个月债 券A	博远鑫享三个月债 券C	博远鑫享三个月 债券E	合计
博远基金	0.00	0.00	399.66	399.66
合计	0.00	0.00	399.66	399.66

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%，E类基金份额的销售服务费年费率为0.01%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{C类、E类基金份额对应的销售服务年费率} \div \text{当年天数}$$

H为C类、E类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类、E类基金份额前一日的基金资产净值

基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.4.2 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。

**6.4.10.5 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 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
宁波银行股份有限公司	2,122,100.02	35,814.25

注：本基金的上述银行存款由基金托管人宁波银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金**

本基金报告期末进行利润分配。

**6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	320	32,000.00	32,000.00	-

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2021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7,499,876.25元，是以如下债券作为抵押：

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
101751025	17越秀集团MTN001	2021-07-01	102.50	100,000	10,250,000.00
合计				100,000	10,250,000.00

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末2021年6月30日止，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4,999,975.00元，截至2021年7月1日到期。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。

**6.4.13 金融工具风险及管理****6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为债券型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型证券投资基金和股票型证券投资基金，属于中低风险收益特征的基金产品。本基金投资的金融工具主要为债券投资，也可择机配置股票资产。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通过灵活的资产配置和主动的投资管理，拓展大类资产配置空间，在精选个股、个券的基础上适度集中投资，在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期稳健增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(公司风险控制委员会)、专业监控(风险监察部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在管理层下设立风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议指导业务部门开展工作；在业务操作层面，风险监察部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行，同时履行风险量化评估分析职责。

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。

#### 6.4.13.2 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不利变化的风险。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行，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，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，涉及信用风险的投资品种在入公司备选库前均由信用研究员进行深入的研究支持与风险分析，且基金通过分散化投资以分散信用风险。

于本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为90.17%(上年度末：38.92%)。

##### 6.4.13.2.1 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	7,049,114.10	10,011,000.00
合计	7,049,114.10	10,011,000.00

注：未评级部分为国债。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**6.4.13.2.4 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	88,231,165.29	80,856,443.00
AAA以下	15,091,950.47	4,802,463.47
未评级	-	1,201,123.50
合计	103,323,115.76	86,860,029.97

注：未评级部分为国债、政策性金融债。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**6.4.13.3 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可随时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。

**6.4.13.3.1 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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可能带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本期末，本基金持有流动性受限资产的估值占基金资产净值比例为0.92%。本基金组合资产中7个工作日可变现资产超过最近工作日确认的净赎回金额。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“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外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债（如有）的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年06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	2,122,100.02	-	-	-	2,122,100.02
存出保证金	1,260,730.46	-	-	-	1,260,730.46
交易性金融资产	27,760,406.60	74,474,658.21	8,137,165.05	12,576,735.88	122,948,965.74
应收利息	-	-	-	1,224,035.94	1,224,035.94
资产总计	31,143,237.08	74,474,658.21	8,137,165.05	13,800,771.82	127,555,832.16
负债					

卖出回购金融资产款	12,499,851.25	-	-	-	12,499,851.25
应付赎回款	-	-	-	306,151.94	306,151.94
应付管理人报酬	-	-	-	38,613.48	38,613.48
应付托管费	-	-	-	9,653.35	9,653.35
应付销售服务费	-	-	-	13,042.59	13,042.59
应付交易费用	-	-	-	13,811.22	13,811.22
应交税费	-	-	-	8,382.05	8,382.05
应付利息	-	-	-	1,870.33	1,870.33
其他负债	-	-	-	81,822.86	81,822.86
负债总计	12,499,851.25	-	-	473,347.82	12,973,199.07
利率敏感度缺口	18,643,385.83	74,474,658.21	8,137,165.05	13,327,424.00	114,582,633.09
上年度末 2020年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	26,136,022.99	-	-	-	26,136,022.99
存出保证金	19,608,667.32	-	-	-	19,608,667.32
交易性金融资产	11,212,123.50	81,945,280.50	3,713,625.97	34,105,165.72	130,976,195.69
买入返售金融资产	60,008,270.00	-	-	-	60,008,270.00
应收利息	-	-	-	1,087,755.74	1,087,755.74
资产总计	116,965,083.81	81,945,280.50	3,713,625.97	35,192,921.46	237,816,911.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	17,537,915.31	17,537,915.31
应付管理人报酬	-	-	-	75,084.19	75,084.19
应付托管费	-	-	-	18,771.03	18,771.03
应付销售服务费	-	-	-	10,633.46	10,633.46
应付交易费用	-	-	-	18,503.17	18,503.17
应交税费	-	-	-	9,850.86	9,850.86
其他负债	-	-	-	71,687.63	71,687.63
负债总计	-	-	-	17,742,445.65	17,742,445.65
利率敏感度缺口	116,965,083.81	81,945,280.50	3,713,625.97	17,450,475.81	220,074,466.09

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

**6.4.13.4.1.2 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: 人民币元)	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率上升25个基点	-474,780.30	-543,271.44
	市场利率下降25个基点	479,059.01	548,622.93

**6.4.13.4.2 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, 因此无外汇风险。

**6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券, 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中, 通过对宏观经济情况及政策的分析, 结合证券市场运行情况, 做出资产配置及组合构建的决定; 通过对单个证券的定性分析及定量分析, 选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化, 对投资策略、资产配置、投资组合进行修正, 来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金债券资产的投资比例不低于基金资产的80%; 股票及存托凭证资产的投资比例为基金资产的0-20%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外, 本基金的基金管理人定期或不定期运用压力测试对基金进行风险度量, 测试本基金面临的潜在价格风险, 及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

**6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020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	12,576,735.88	10.98	34,105,165.72	15.50
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	12,576,735.88	10.98	34,105,165.72	15.50

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数收益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:人民币元)	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	沪深300指数收益率上升5%	651,830.09	1,802,273.00
	沪深300指数收益率下降5%	-651,830.09	-1,802,273.00

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §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	12,576,735.88	9.86
	其中：股票	12,576,735.88	9.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	110,372,229.86	86.53
	其中：债券	110,372,229.86	86.53
	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	2,122,100.02	1.66
8	其他各项资产	2,484,766.40	1.95
9	合计	127,555,832.16	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	-	-
C	制造业	10,511,002.88	9.17
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	470,595.00	0.41
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	1,377,410.00	1.20
M	科学研究和技术服务业	217,728.00	0.19
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	12,576,735.88	10.98

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 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(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	601888	中国中免	3,900	1,170,390.00	1.02
2	688012	中微公司	4,895	812,178.40	0.71
3	300601	康泰生物	4,700	700,300.00	0.61
4	002415	海康威视	10,100	651,450.00	0.57
5	300408	三环集团	14,800	627,816.00	0.55
6	600584	长电科技	15,000	565,200.00	0.49
7	600276	恒瑞医药	8,000	543,760.00	0.47
8	301006	迈拓股份	17,400	530,700.00	0.46
9	688200	华峰测控	1,053	498,416.49	0.43
10	300724	捷佳伟创	4,100	475,641.00	0.42
11	601166	兴业银行	22,900	470,595.00	0.41
12	002938	鹏鼎控股	13,100	470,028.00	0.41
13	688578	艾力斯	14,194	467,976.18	0.41

14	688366	昊海生科	2,054	429,902.20	0.38
15	300258	精锻科技	26,200	350,294.00	0.31
16	688559	海目星	11,307	341,810.61	0.30
17	002136	安纳达	23,200	333,616.00	0.29
18	600380	健康元	23,800	326,774.00	0.29
19	000333	美的集团	4,100	292,617.00	0.26
20	002847	盐津铺子	2,700	269,244.00	0.23
21	300718	长盛轴承	15,600	250,692.00	0.22
22	300767	震安科技	2,900	240,845.00	0.21
23	300115	长盈精密	11,500	236,900.00	0.21
24	600741	华域汽车	8,700	228,549.00	0.20
25	603658	安图生物	3,000	227,310.00	0.20
26	600161	天坛生物	6,500	222,625.00	0.19
27	601965	中国汽研	12,600	217,728.00	0.19
28	002027	分众传媒	22,000	207,020.00	0.18
29	002064	华峰化学	11,100	157,620.00	0.14
30	300558	贝达药业	1,300	140,712.00	0.12
31	603605	珀莱雅	600	118,026.00	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	601818	光大银行	3,135,101.00	1.42
2	688063	派能科技	2,561,681.65	1.16
3	002304	洋河股份	2,213,199.00	1.01
4	601398	工商银行	2,062,588.00	0.94
5	600036	招商银行	2,016,495.00	0.92
6	600309	万华化学	1,975,910.00	0.90
7	601166	兴业银行	1,768,074.00	0.80

8	600584	长电科技	1,726,087.00	0.78
9	600519	贵州茅台	1,694,061.00	0.77
10	601233	桐昆股份	1,589,702.00	0.72
11	601318	中国平安	1,587,412.00	0.72
12	601628	中国人寿	1,568,359.00	0.71
13	688019	安集科技	1,546,435.79	0.70
14	002044	美年健康	1,430,889.00	0.65
15	601888	中国中免	1,259,387.00	0.57
16	002311	海大集团	1,207,888.00	0.55
17	601658	邮储银行	1,190,284.00	0.54
18	601857	中国石油	1,175,601.00	0.53
19	002460	赣锋锂业	1,033,167.00	0.47
20	688012	中微公司	1,000,687.02	0.45

注：本项中“本期累计买入金额”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	601888	中国中免	8,653,094.00	3.93
2	601818	光大银行	6,202,376.00	2.82
3	688063	派能科技	5,562,430.82	2.53
4	601166	兴业银行	4,617,294.00	2.10
5	000001	平安银行	4,184,641.00	1.90
6	600926	杭州银行	3,980,803.33	1.81
7	002304	洋河股份	3,020,641.00	1.37
8	600519	贵州茅台	2,527,081.00	1.15
9	002064	华峰化学	2,104,878.00	0.96
10	600036	招商银行	2,057,359.00	0.93
11	601398	工商银行	2,028,998.00	0.92

12	601318	中国平安	1,938,892.00	0.88
13	601939	建设银行	1,791,971.00	0.81
14	688019	安集科技	1,775,641.84	0.81
15	600309	万华化学	1,716,722.00	0.78
16	002044	美年健康	1,694,683.00	0.77
17	601233	桐昆股份	1,616,450.00	0.73
18	002311	海大集团	1,586,643.00	0.72
19	601628	中国人寿	1,498,591.00	0.68
20	601857	中国石油	1,162,733.00	0.53

注：本项中“本期累计卖出金额”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

买入股票成本（成交）总额	61,459,015.56
卖出股票收入（成交）总额	85,230,730.00

注：本项“买入股票成本”和“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	7,049,114.10	6.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	19,989,000.00	17.45
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	70,509,000.00	61.54
7	可转债(可交换债)	12,825,115.76	11.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	110,372,229.86	96.33
----	----	----------------	-------

### 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	101751025	17越秀集团MTN001	100,000	10,250,000.00	8.95
2	101901455	19国电MTN004	100,000	10,113,000.00	8.83
3	101900538	19中电投MTN004	100,000	10,087,000.00	8.80
4	155804	19华创04	100,000	10,080,000.00	8.80
5	102000034	20南电MTN001	100,000	10,068,000.00	8.79

**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**  
无。

**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**  
无。

**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**  
无。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**  
无。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**  
无。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除**20中油股MTN001（102000621.IB）**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20中油股MTN001（102000621.IB）发行主体为中国石油天然气股份有限公司。拜泉县人民法院于2021年6月18日将其纳入被执行人（(2021)黑0231执836号），执行金额1488元。本基金认为，以上处罚不会对其投资价值构成实质性影响。

7.12.2 本基金投资的前十名股票无超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	1,260,730.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,224,035.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,484,766.40

### 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	123069	金诺转债	1,710,488.56	1.49
2	113044	大秦转债	1,268,880.30	1.11
3	110059	浦发转债	1,024,300.00	0.89
4	132015	18中油EB	1,022,500.00	0.89
5	110053	苏银转债	673,548.00	0.59
6	113009	广汽转债	576,292.50	0.50
7	128035	大族转债	456,761.48	0.40
8	110068	龙净转债	358,278.40	0.31
9	123050	聚飞转债	342,031.85	0.30

10	128081	海亮转债	234,238.48	0.20
11	128135	洽洽转债	228,404.00	0.20
12	113599	嘉友转债	227,624.40	0.20
13	128124	科华转债	13,557.51	0.01

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

### §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
博远鑫享三个月债券A	133	480,543.98	50,344,954.54	78.77%	13,567,395.33	21.23%
博远鑫享三个月债券C	86	431,450.50	29,366,634.98	79.15%	7,738,107.65	20.85%
博远鑫享三个月债券E	3	2,478,391.32	4,723,665.56	63.53%	2,711,508.40	36.47%
合计	218	497,487.46	84,435,255.08	77.85%	24,017,011.38	22.15%

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

无。

**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情况**

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博远鑫享三个月债券A	0
	博远鑫享三个月债券C	0
	博远鑫享三个月债券E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	博远鑫享三个月债券A	0
	博远鑫享三个月债券C	0
	博远鑫享三个月债券E	0
	合计	0

**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

	博远鑫享三个月债券A	博远鑫享三个月债券C	博远鑫享三个月债券E
基金合同生效日(2020年09月30日)基金份额总额	106,179,764.04	28,417,145.82	83,817,866.90
本报告期期初基金份额总额	103,970,911.20	18,350,132.84	92,680,592.51
本报告期基金总申购份额	12,563,260.60	28,005,940.20	4,723,665.56
减：本报告期基金总赎回份额	52,621,821.93	9,251,330.41	89,969,084.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	63,912,349.87	37,104,742.63	7,435,173.96

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会，无相关决议。

### 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

#### 1.基金管理人员的重大人事变动情况

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

#### 2.基金托管人的重大人事变动情况

本报告期内，本基金托管人无重大人事变动。

### 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，本基金投资策略无变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 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，本基金管理人、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	
中金财富证券	2	146,689,745.56	100.00%	109,497.71	100.00%	-

注：1、本基金使用证券公司交易结算模式，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》关于交易佣金分仓的规定。

- 2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准包括：公司基本面评价（财务情况、经营情况）、公司券商结算模式服务评价（稳定性、及时性）等方面。
- 3、基金证券经纪商选择程序为：本基金管理人根据上述标准考察后确定选用证券经纪商，并与其签订证券经纪服务协议。
- 4、报告期内，本基金通过中金财富证券的专用交易单元进行场内证券交易，无其他新增或停止使用的交易单元。

### 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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中金财富证券	82,042,906.45	100.00%	119,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 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	博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金2020年第四季度报告	规定媒介	2021-01-21
2	博远基金管理有限公司旗下全部基金2020年第4季度报告提示性公告	规定媒介	2021-01-21
3	关于博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金增加宁波银行股份有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2021-02-05
4	关于博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2021-03-06
5	关于博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金增加销	规定媒介	2021-03-06

	售机构的公告		
6	博远基金管理有限公司关于旗下全部基金2020年年度报告提示性公告	规定媒介	2021-03-26
7	博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金2020年年度报告	规定媒介	2021-03-26
8	博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	规定媒介	2021-03-26
9	博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	规定媒介	2021-03-26
10	博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金(E类份额)基金产品资料概要更新	规定媒介	2021-03-26
11	博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金招募说明书(更新)	规定媒介	2021-03-26
12	博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金2021年第一季度报告	规定媒介	2021-04-21
13	博远基金管理有限公司旗下部分基金2021年第1季度报告提示性公告	规定媒介	2021-04-21
14	博远基金管理有限公司关于旗下基金参与浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-04-27
15	博远基金管理有限公司关于旗下基金参与东方财富证券股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-04-27

16	博远基金管理有限公司关于旗下部分基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2021-04-27
17	博远基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券股份有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2021-04-27
18	关于博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2021-06-11
19	博远基金管理有限公司关于旗下基金参与泛华普益基金销售有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-29
20	博远基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泛华普益基金销售有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2021-06-29

## §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

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	20210105-20210307 20210322-20210630	25,003,500.00	0.00	1,986,000.00	23,017,500.00	21.22%

#### 产品特有风险

- (1) 不能及时应对赎回的风险  
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。
- (2) 基金净值大幅波动的风险  
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。

(3) 基金规模较小导致的风险

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。

(4) 基金面临转型、合并或提前终止的风险

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。

## 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、中国证监会批准博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金注册的文件;
- 2、《博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》;
- 3、《博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金托管协议》;
- 4、《博远鑫享三个月持有期债券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。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路5001号深业上城(南区)T2栋4301 博远基金管理有限公司

### 12.3 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  
二〇二一年八月二十七日