

---

博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金

2021年第3季度报告

2021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:2021年10月26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2021年10月25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2021年07月01日起至2021年09月30日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 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   |
| 报告期末基金份额总额 | 142,472,372.83份   |
| 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。   |                |               |
| 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 | 88,173,188.38份  | 46,864,010.49份 | 7,435,173.96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(2021年07月01日 - 2021年09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   |
| 1.本期已实现收益      | 1,657,514.93                   | 721,763.94    | 156,688.04   |
| 2.本期利润         | 1,623,973.84                   | 765,479.33    | 161,979.40   |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0194                         | 0.0209        | 0.0218       |
| 4.期末基金资产净值     | 95,179,803.06                  | 50,379,880.46 | 8,025,851.39 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0795                         | 1.0750        | 1.0794       |

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。

### 3.2 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净值表现

| 阶段                     | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③   | ②-④   |
|------------------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三<br>个月              | 2.07%  | 0.22%         | 0.08%          | 0.13%                 | 1.99% | 0.09% |
| 过去六<br>个月              | 3.18%  | 0.18%         | 0.85%          | 0.12%                 | 2.33% | 0.06% |
| 过去一<br>年               | 7.95%  | 0.20%         | 2.69%          | 0.13%                 | 5.26% | 0.07% |
| 自基金<br>合同生<br>效起至<br>今 | 7.95%  | 0.20%         | 2.64%          | 0.13%                 | 5.31% | 0.07% |

博远鑫享三个月债券C净值表现

| 阶段                     | 净值增<br>长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③   | ②-④   |
|------------------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三<br>个月              | 1.95%      | 0.22%         | 0.08%          | 0.13%                 | 1.87% | 0.09% |
| 过去六<br>个月              | 2.97%      | 0.18%         | 0.85%          | 0.12%                 | 2.12% | 0.06% |
| 过去一<br>年               | 7.50%      | 0.20%         | 2.69%          | 0.13%                 | 4.81% | 0.07% |
| 自基金<br>合同生<br>效起至<br>今 | 7.50%      | 0.20%         | 2.64%          | 0.13%                 | 4.86% | 0.07% |

博远鑫享三个月债券E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      | 2.05%  | 0.22%     | 0.08%      | 0.13%         | 1.97% | 0.09% |
| 过去六个月      | 3.17%  | 0.18%     | 0.85%      | 0.12%         | 2.32% | 0.06% |
| 过去一年       | 7.94%  | 0.20%     | 2.69%      | 0.13%         | 5.25% | 0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.94%  | 0.20%     | 2.64%      | 0.13%         | 5.30% | 0.07% |

### 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

(2020年09月30日-2021年09月30日)



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：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 |        |  |
| 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，无损害基金份额持有人利益的行为。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



三季度宏观经济进一步趋缓。生产受缺煤限电、洪涝灾害、疫情反复、内需偏弱、大宗商品价格高位运行等影响趋缓。短期受疫情多地反弹以及汽车消费持续回落影响，消费表现持续低迷，大幅下滑。预计与地产周期下行下财富效应递减也存在相关性。出口数据持续略超预期，带动制造业企业盈利的持续高增长，一定程度支撑了制造业投资。基建投资增速仍在低位，两年复合增速为负数，财政后置对基建增速影响显著。地产投资逐月向下，地产销售下滑对投资端的影响开始显现。

债券市场在三季度有明显的降准超预期行情。7月份降准政策的时点和量均较为超预期。十年政策性金融债和国债大约下行25-30bp左右。不过降准并没有带来资金面超预期的宽松，三季度后半段市场交易较为平淡。一方面经济放缓，政策收紧概率不大。另一方面，由于能耗双控和缺煤等诸多因素影响了大宗商品暴涨，市场担心短时间内货币政策继续边际放松会受到掣肘，同时担心地方政府债券的供应及信用环境可能回暖。

股票市场在春节后的下跌恐慌中逐步修复。主要源于国内外流动性改善的预期。以美国为代表的海外流动性充裕，纳斯达克指数为代表的美国科技板块指数不断创出新高。国内流动性也较为平稳，对之前担心通胀会带来紧缩的预期有所修复。景气度较高的新能源汽车板块、医美板块等表现较为亮眼，而受经济增长趋缓担心的周期板块表现相对弱势。

本季度本基金债券方面以持有获取票息策略为主，久期中性。股票方面，仓位调整至中位水平。转债方面，增加了偏债型转债的配置。

展望四季度，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。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。

#### 4.5 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1.0795元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.07%，同期业绩比较基准收益率为0.08%；截至报告期末，博远鑫享三个月债券C基金份额净值为1.0750元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.95%，同期业绩比较基准收益率为0.08%；截至报告期末，博远鑫享三个月债券E基金份额净值为1.0794元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.05%，同期业绩比较基准收益率为0.08%。

#### 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或者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              | 15,869,487.00  | 8.98          |
|    | 其中：股票             | 15,869,487.00  | 8.98          |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 152,085,294.23 | 86.02         |
|    | 其中：债券             | 152,085,294.23 | 86.02         |
|    | 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      | 1,860,667.81   | 1.05          |
| 8  | 其他资产              | 6,994,909.39   | 3.96          |
| 9  | 合计                | 176,810,358.43 | 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         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | -             | -             |
| C  | 制造业              | 10,605,891.00 | 6.91          |
| 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  | 1,051,596.00  | 0.68          |
| J  | 金融业              | -             | -             |
| K  | 房地产业             | -             | -             |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业      | 4,212,000.00  | 2.74  |
| 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            | 15,869,487.00 | 10.33 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 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  | 601888 | 中国中免 | 16,200 | 4,212,000.00 | 2.74          |
| 2  | 300896 | 爱美客  | 3,800  | 2,252,678.00 | 1.47          |
| 3  | 601208 | 东材科技 | 71,000 | 1,131,030.00 | 0.74          |
| 4  | 300496 | 中科创达 | 8,400  | 1,051,596.00 | 0.68          |
| 5  | 300601 | 康泰生物 | 9,000  | 991,170.00   | 0.65          |
| 6  | 002049 | 紫光国微 | 4,600  | 951,280.00   | 0.62          |
| 7  | 300782 | 卓胜微  | 2,600  | 915,200.00   | 0.60          |
| 8  | 000858 | 五粮液  | 2,900  | 636,231.00   | 0.41          |
| 9  | 300595 | 欧普康视 | 6,800  | 555,288.00   | 0.36          |
| 10 | 600150 | 中国船舶 | 21,400 | 537,140.00   | 0.35          |

### 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 | 8,506,346.70 | 5.54          |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 2  | 央行票据      | -              | -     |
| 3  | 金融债券      | 40,928,000.00  | 26.65 |
|    | 其中：政策性金融债 | 40,928,000.00  | 26.65 |
| 4  | 企业债券      | 30,197,000.00  | 19.66 |
| 5  | 企业短期融资券   | 10,023,000.00  | 6.53  |
| 6  | 中期票据      | 50,451,000.00  | 32.85 |
| 7  | 可转债（可交换债） | 11,979,947.53  | 7.80  |
| 8  | 同业存单      | -              | -     |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 152,085,294.23 | 99.02 |

### 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  | 200215    | 20国开15       | 200,000 | 20,610,000.00 | 13.42        |
| 2  | 210210    | 21国开10       | 200,000 | 20,318,000.00 | 13.23        |
| 3  | 101751025 | 17越秀集团MTN001 | 100,000 | 10,171,000.00 | 6.62         |
| 4  | 1780085   | 17铁道06       | 100,000 | 10,140,000.00 | 6.60         |
| 5  | 102100344 | 21华为MTN002   | 100,000 | 10,128,000.00 | 6.59         |

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  
无。

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  
无。

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  
无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
无。

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中除20国开15（200215.IB）、21国开10（210210.IB）、21华为MTN002（102100344.IB）、20南电MTN001（102000034.IB）、21电网CP002（102000034.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国开15（200215.IB）、21国开10（210210.IB）发行主体国家开发银行因未依法履行职责、信息披露虚假或严重误导性陈述、违规经营、产品不合格等事项，于2020年12月25日受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字〔2020〕67号）。

本基金投资的前十名证券之一的21华为MTN002（102100344.IB）发行主体华为投资控股有限公司因违反了《中华人民共和国建筑法》第六十一条第二款之规定，东莞市纪委监委、东莞市公安局、东莞市消防救援支队、东莞市应急管理局、东莞市住房和城乡建设、东莞市市场监管局、东莞市城市管理和综合执法局、东莞市总工会、东莞市松山湖高新区管委会建议由住建部门依据《建设工程质量管理条例》第五十八条第（一）项规定，对其进行行政处罚。

本基金投资的前十名证券之一的20南电MTN001（102000034.IB）、21电网CP002（102000034.IB）发行主体中国南方电网有限责任公司、国家电网有限公司因未依法履行职责，国家能源局对其责令整改。

本基金认为，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无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   | 4,644,760.13 |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 2,350,149.26 |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 6,994,909.39 |

### 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  | 113044 | 大秦转债 | 1,356,987.20 | 0.88         |

|    |        |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 2  | 132015 | 18中油EB | 1,048,100.00 | 0.68 |
| 3  | 110059 | 浦发转债   | 1,039,100.00 | 0.68 |
| 4  | 128135 | 洽洽转债   | 976,402.35   | 0.64 |
| 5  | 110068 | 龙净转债   | 583,555.20   | 0.38 |
| 6  | 113619 | 世运转债   | 535,798.20   | 0.35 |
| 7  | 113605 | 大参转债   | 497,200.80   | 0.32 |
| 8  | 123065 | 宝莱转债   | 418,905.69   | 0.27 |
| 9  | 128035 | 大族转债   | 288,422.53   | 0.19 |
| 10 | 113607 | 伟20转债  | 251,746.30   | 0.16 |
| 11 | 113599 | 嘉友转债   | 242,697.60   | 0.16 |
| 12 | 110070 | 凌钢转债   | 129,903.60   | 0.08 |
| 13 | 128144 | 利民转债   | 59,693.67    | 0.04 |
| 14 | 128124 | 科华转债   | 13,355.24    | 0.01 |
| 15 | 110053 | 苏银转债   | 5,838.00     | 0.00 |

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 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

|                               | 博远鑫享三个月<br>债券A | 博远鑫享三个月<br>债券C | 博远鑫享三个月<br>债券E |
|-------------------------------|----------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 63,912,349.87  | 37,104,742.63  | 7,435,173.96   |
| 报告期期间基金总申购份<br>额              | 32,668,149.52  | 15,305,028.34  | -              |
| 减：报告期期间基金总赎<br>回份额            | 8,407,311.01   | 5,545,760.48   | -              |
| 报告期期间基金拆分变动<br>份额(份额减少以“-”填列) | -              | -              | -              |
| 报告期期末基金份额总额                   | 88,173,188.38  | 46,864,010.49  | 7,435,173.96   |

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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              | 20210729-20210912<br>20210916-20210921 | 0.00          | 28,015,502.43 | 0.00       | 28,015,502.43 | 19.66% |
|   | 2              | 20210701-20210728                      | 23,017,500.00 | 0.00          | 0.00       | 23,017,500.00 | 16.16% |
| 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。

### 9.2 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

### 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

2021年10月26日