

# 博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 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:2022 年 08 月 25 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2022年08月24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2022年01月01日起至2022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遵规守信情况的说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	55
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
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.....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

## §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	264,474,897.62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	167,857,423.12份	31,673,814.21份	64,943,660.29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	<p>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。</p> <p>(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</p>

	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。

### 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
	联系电话	0755-29395888
	电子邮箱	compliance@boyuanfunds.com
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 (2022年01月01日-2022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	-1,836,663.30	-530,070.79	-745,028.14
本期利润	74,277.05	-883,040.45	-85,780.96
加权平均基金份额本期利润	0.0005	-0.0196	-0.0013
本期加权平均净值利润率	0.04%	-1.93%	-0.13%
本期基金份额净值增长率	-0.02%	-0.22%	-0.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)		
期末可供分配利润	1,892,357.85	119,550.33	726,503.84
期末可供分配基金份额利润	0.0113	0.0038	0.0112
期末基金资产净值	171,685,461.33	32,154,156.73	66,418,788.45
期末基金份额净值	1.0228	1.0152	1.0227
3.1.3 累计期末指标	报告期末		

	(2022年06月30日)		
基金份额累计净值增长率	9.88%	9.11%	9.87%

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、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	2.61%	0.29%	0.72%	0.10%	1.89%	0.19%
过去三个月	3.47%	0.29%	0.93%	0.14%	2.54%	0.15%
过去六个月	-0.02%	0.30%	-0.51%	0.15%	0.49%	0.15%
过去一年	3.90%	0.26%	0.28%	0.13%	3.62%	0.13%
自基金合同生效起至今	9.88%	0.23%	2.84%	0.13%	7.04%	0.10%

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	2.58%	0.29%	0.72%	0.10%	1.86%	0.19%
过去三个月	3.37%	0.29%	0.93%	0.14%	2.44%	0.15%
过去六个月	-0.22%	0.30%	-0.51%	0.15%	0.29%	0.15%
过去一年	3.48%	0.26%	0.28%	0.13%	3.20%	0.13%
自基金合同生效起至今	9.11%	0.23%	2.84%	0.13%	6.27%	0.10%

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	2.60%	0.29%	0.72%	0.10%	1.88%	0.19%
过去三个月	3.46%	0.29%	0.93%	0.14%	2.53%	0.15%
过去六个月	-0.03%	0.30%	-0.51%	0.15%	0.48%	0.15%
过去一年	3.88%	0.26%	0.28%	0.13%	3.60%	0.13%
自基金合同 生效起至今	9.87%	0.23%	2.84%	0.13%	7.03%	0.10%

### 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

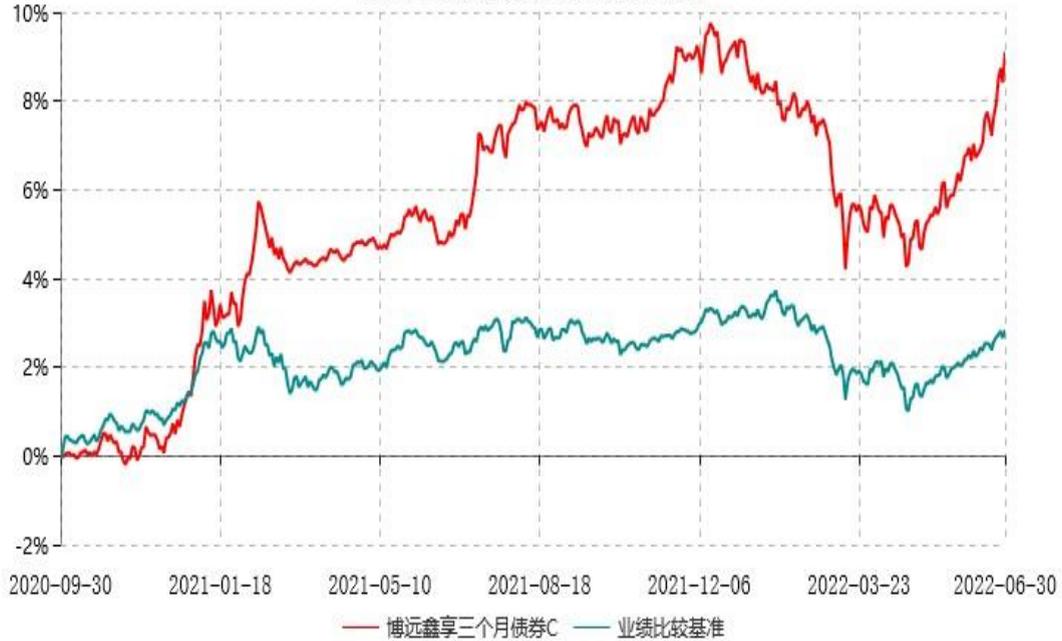
博远鑫享三个月债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年09月30日-2022年06月30日)



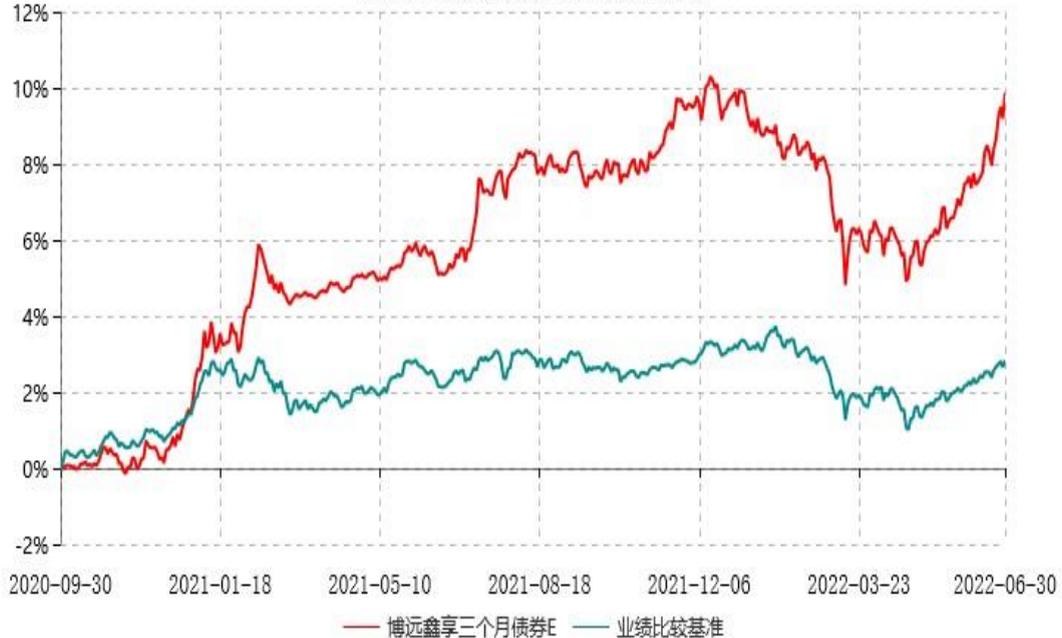
博远鑫享三个月债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年09月30日-2022年06月30日)



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

(2020年09月30日-2022年06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7只公开募集证券投资基金。

#### 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	-	25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。2021年12月13日起兼任博远臻享3个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2022年4月28日起兼任博远增益纯债债券型证券投资基金基金经理。
余丽旋	本基金基金经理	2020-10-26	-	11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总经理兼基金经理。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。2021年12月7日起兼任博远臻享3个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。
黄婧丽	本基金基金经理	2022-03-08	-	9年	黄婧丽女士，中国国籍，具有基金从业资格，毕业于伦敦帝国理工学院，硕士研究生。历任世纪证券有限责任公司固定收益研究员、国海证券股份有限公司固定收益投资经理助理、东吴基金管理有限公司投

					<p>资经理、基金经理。2018年1月至2021年1月任东吴优益债券型证券投资基金基金经理；2018年5月至2020年12月任东吴悦秀纯债债券型证券投资基金基金经理；2018年11月至2021年7月任东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金经理；2019年3月至2021年1月任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理。2021年12月13日起任博远臻享3个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2022年3月8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。2022年6月2日起兼任博远增益纯债债券型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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、本基金现任基金经理余丽旋女士因休产假，自2022年3月21日起暂不能正常履行基金经理职责，本基金管理人已于2022年3月19日发布了相关公告。

#### 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 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

2022年以来，国内外宏观环境仍然呈现复杂多变的局面。海外方面，俄乌冲突爆发，欧美各国通胀持续居高不下，发达经济体加息节奏加快。国内方面，3-4月多个一线城市疫情的扩散，使得原本稍有起色的经济再遇阴霾。在经济下行的过程中，村镇银行信用事件、房贷断供事件等黑天鹅开始出现，市场风险偏好也因此有所降低。

债券市场前半年整体呈现区间波动的走势，其中2月、6月调整幅度较大，但在7月以后，在各种信用事件的催化下，资金面持续宽松，货币利率维持低位，带动债券利率加速下行，突破了今年以来区间震荡的下沿。

股票市场一季度表现较弱，在疫情的冲击下，3-4月下跌加剧，随后在4月底触底后出现了快速的反弹，以4月27日为分界线，截至二季度末，上证指数上涨17.74%，创业板指上涨30.69%。

报告期内，在债券投资上，本基金采取相对防御策略，大部分仓位配置于高等级、中短久期的信用债，控制组合整体的债券久期。权益投资上，本基金继续遵循自下而上的投资逻辑，主要持有标的仓位稳定，行业配置分散。基于稳增长的政策信心，及部分高成长个股估值在底部的考虑，投资组合在二季度提高了权益仓位。

##### 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1.0228元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.02%，同期业绩比较基准收益率为-0.51%；截至报告期末，博远鑫享三个月债券C基金份额净值为1.0152元，本报告期内，该类基金份额净值增长

率为-0.22%，同期业绩比较基准收益率为-0.51%；截至报告期末，博远鑫享三个月债券E基金份额净值为1.0227元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.03%，同期业绩比较基准收益率为-0.51%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，我们认为尽管宏观环境仍然存在较多不确定性，但预期最为悲观的时间已经过去，市场信心在逐渐恢复。在流动性大概率维持宽松的背景下，股票市场继续存在结构性机会。我们将继续做好均衡配置以及个股挖掘，争取抓住更多的结构性机会。债券方面，考虑到市场整体收益率已处于相对偏低水平，但经济大幅回升仍然存在较大不确定性，预计组合将继续以配置中短久期的信用债获取票息为主，并择机参与利率债的波段机会。

#### 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，本基金先后于1月26日、3月2日进行分红。1月26日，博远鑫享三个月债券A已分配利润7,142,705.71元，博远鑫享三个月债券C已分配利润2,630,738.24元，博远鑫享三个月债券E已分配利润2,919,117.03元（A类每10份基金份额分红0.450元，C类每10份基金份额分红0.450元，E类每10份基金份额分红0.450元）；3月2日，博远鑫享三个月债券A已分配利润4,880,258.39元，博远鑫享三个月债券C已分配利润1,909,018.20元，博远鑫享三个月债券E已分配利润1,947,375.87元（A类每10份基金份额分红0.300元，C类每10份基金份额分红0.300元，E类每10份基金份额分红0.300元），符合基金合同约定的分红比例。

#### 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《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《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“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均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 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,938,776.78	541,757.31
结算备付金		-	-

存出保证金		1,331,947.29	256,976.50
交易性金融资产	6.4.7.2	306,449,656.89	308,669,309.64
其中：股票投资		51,608,389.96	50,810,794.73
基金投资		-	-
债券投资		254,841,266.93	257,858,514.91
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	2,048.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	3,981,070.67
资产总计		309,720,380.96	313,451,162.48
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		38,823,183.58	9,499,853.50
应付清算款		-	-

应付赎回款		409,528.68	-
应付管理人报酬		90,147.01	62,657.27
应付托管费		22,536.75	15,664.35
应付销售服务费		11,420.29	21,364.93
应付投资顾问费		-	-
应交税费		14,716.31	6,523.74
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	90,441.83	172,938.30
负债合计		39,461,974.45	9,779,002.09
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	264,474,897.62	276,591,194.70
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	5,783,508.89	27,080,965.69
净资产合计		270,258,406.51	303,672,160.39
负债和净资产总计		309,720,380.96	313,451,162.48

注:报告截止日2022年06月30日,基金份额总额264,474,897.62份,其中博远鑫享三个月债券A基金份额167,857,423.12份,基金份额净值1.0228元;博远鑫享三个月债券C基金份额31,673,814.21份,基金份额净值1.0152元;博远鑫享三个月债券E基金份额64,943,660.29份,基金份额净值1.0227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:2022年01月01日至2022年06月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年06月30日
一、营业总收入		487,464.24	4,521,473.35
1.利息收入		122,679.07	1,594,097.23
其中:存款利息收入	6.4.7.9	20,704.89	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		101,974.18	35,438.93
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,864,920.79	6,032,854.12
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-7,853,259.05	5,266,222.44
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	5,423,514.56	706,204.68
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	564,823.70	60,427.00
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,217,217.87	-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）	6.4.7.18	12,488.09	12,535.60
<b>减：二、营业总支出</b>		1,382,008.60	753,858.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	549,729.50	225,823.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	137,432.36	56,455.92
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	94,874.22	58,750.61
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		488,841.89	96,945.18
其中：卖出回购金融资产支出		488,841.89	96,945.18
6. 信用减值损失		-	-

7. 税金及附加		10,577.77	4,146.08
8. 其他费用	6.4.7.19	100,552.86	311,737.15
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-894,544.36	3,767,614.43
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-894,544.36	3,767,614.43
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-894,544.36	3,767,614.43

### 6.3 净资产(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: 2022年01月01日至2022年06月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	276,591,194.70	-	27,080,965.69	303,672,160.39
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)	276,591,194.70	-	27,080,965.69	303,672,160.39
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,116,297.08	-	-21,297,456.80	-33,413,753.88
(一)、综合收益总额	-	-	-894,544.36	-894,544.36
(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)	-12,116,297.08	-	1,026,301.00	-11,089,996.08

其中：1.基金申购款	49,892,448.22	-	775,905.47	50,668,353.69
2.基金赎回款	-62,008,745.30	-	250,395.53	-61,758,349.77
(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)	-	-	-21,429,213.44	-21,429,213.44
(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)	264,474,897.62	-	5,783,508.89	270,258,406.51
项目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	215,001,636.55	-	5,072,829.54	220,074,466.09
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)	215,001,636.55	-	5,072,829.54	220,074,466.09
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-106,549,370.09	-	1,057,537.09	-105,491,833.00
(一)、综合收益总额	-	-	3,767,614.43	3,767,614.43
(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)	-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
(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)	108,452,266.46	-	6,130,366.63	114,582,633.09

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

王紫冰

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

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×90%+沪深300指数收益率×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》和在财务报表附注所列示的中国证监会、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2022年度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2022年6月30日的财务状况以及2022年1月1日至2022年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 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

除以下会计政策变更外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失

计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

#### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

### 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 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号--金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号--金融资产转移》、《企业会计准则第24号一套期会计》及《企

业会计准则第37号--金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外, 中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定, 本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额, 2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日, 本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于2022年1月1日, 本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、应收利息和应收申购款, 金额分别为541,757.31元、256,976.50元、3,981,070.67元和2,048.36元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款, 金额分别为542,455.19元、257,098.13元、0.00元和2,048.36元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为308,669,309.64元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为312,649,560.80元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和应付利息, 金额分别为9,499,853.50元、62,657.27元、15,664.35元、21,364.93元、9,127.50元和-1,189.20元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付利息, 金额分别为9,498,664.30元、62,657.27元、15,664.35元、21,364.93元、9,127.50元和0.00元。

i) 于2021年12月31日, 本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日, 本基金根据新金融工具准则下的计量类别, 将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示, 无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 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 2022年06月30日
活期存款	1,938,776.78
等于: 本金	1,937,991.38
加: 应计利息	785.40
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	1,938,776.78

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		48,142,222.08	-	51,608,389.96	3,466,167.88
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	69,960,249.62	847,657.82	70,711,719.55	-96,187.89
	银行间市场	180,695,874.79	2,365,547.38	184,129,547.38	1,068,125.21
	合计	250,656,124.41	3,213,205.20	254,841,266.93	971,937.32
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		298,798,346.49	3,213,205.20	306,449,656.89	4,438,105.20

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	8,618.97
其中：交易所市场	-

银行间市场	8,618.97
应付利息	-
预提费用-审计费	22,315.49
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	90,441.83

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 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 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	154,208,064.89	154,208,064.89
本期申购	40,547,523.51	40,547,523.51
本期赎回（以“-”号填列）	-26,898,165.28	-26,898,165.28
本期末	167,857,423.12	167,857,423.12

##### 6.4.7.7.2 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 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	57,513,862.50	57,513,862.50
本期申购	9,270,531.73	9,270,531.73
本期赎回（以“-”号填列）	-35,110,580.02	-35,110,580.02
本期末	31,673,814.21	31,673,814.21

##### 6.4.7.7.3 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 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	64,869,267.31	64,869,267.31
本期申购	74,392.98	74,392.98
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	64,943,660.29	64,943,660.29

注：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)。

## 6.4.7.8 未分配利润

### 6.4.7.8.1 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
本期期初	15,064,223.54	215,013.66	15,279,237.20
本期利润	-1,836,663.30	1,910,940.35	74,277.05
本期基金份额交易产生的变动数	687,761.71	-190,273.65	497,488.06
其中：基金申购款	1,063,010.61	-651,122.55	411,888.06
基金赎回款	-375,248.90	460,848.90	85,600.00
本期已分配利润	-12,022,964.10	-	-12,022,964.10
本期末	1,892,357.85	1,935,680.36	3,828,038.21

### 6.4.7.8.2 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
本期期初	5,297,244.16	79,031.05	5,376,275.21
本期利润	-530,070.79	-352,969.66	-883,040.45
本期基金份额交易产生的变动数	-107,866.60	634,730.80	526,864.20
其中：基金申购款	462,724.54	-100,655.87	362,068.67
基金赎回款	-570,591.14	735,386.67	164,795.53
本期已分配利润	-4,539,756.44	-	-4,539,756.44
本期末	119,550.33	360,792.19	480,342.52

**6.4.7.8.3 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
本期期初	6,335,107.81	90,345.47	6,425,453.28
本期利润	-745,028.14	659,247.18	-85,780.96
本期基金份额交易产生的变动数	2,917.07	-968.33	1,948.74
其中：基金申购款	2,917.07	-968.33	1,948.74
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-4,866,492.90	-	-4,866,492.90
本期末	726,503.84	748,624.32	1,475,128.16

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	18,698.66
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	2,006.23
合计	20,704.89

注：其中“其他”为券商结算保证金利息收入。

**6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	60,645,990.83
减：卖出股票成本总额	68,340,269.39

减：交易费用	158,980.49
买卖股票差价收入	-7,853,259.05

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 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 2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	4,097,378.39
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,326,136.17
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	5,423,514.56

##### 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 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	294,812,110.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	289,152,473.53
减：应计利息总额	4,325,508.69
减：交易费用	7,991.87
买卖债券差价收入	1,326,136.17

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	564,823.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	564,823.70

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1.交易性金融资产	2,217,217.87
——股票投资	3,694,844.72
——债券投资	-1,477,626.85
——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	2,217,217.87

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	12,488.09
合计	12,488.09

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。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022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	9,000.00
开户费	400.00
其他	600.00
账户维护费-上清所	8,730.00
合计	100,552.86

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，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的基金交易。

###### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

#### 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 2022年01月01日至202 2年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	549,729.50	225,823.98
其中：支付销售机构的客户维护费	24,045.39	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与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 2022年01月01日至2022 年06月30日	上年度可比期间 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	137,432.36	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 2022年01月01日至2022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 管理有限 公司	0.00	0.00	3,216.72	3,216.72

合计	0.00	0.00	3,216.72	3,216.72
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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
博远基金管理有限公司	0.00	0.00	399.66	399.66
合计	0.00	0.00	399.66	399.66

注：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，销售服务费计提的计算公式如下：

$H = E \times C$ 类、E类基金份额对应的销售服务年费率 ÷ 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

单位：人民币元

本期 2022年01月01日至2022年06月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
宁波银行股份有限公司	19,999,224.93	-	-	-	-	-

#### 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

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 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

本基金本报告期及上年度可比期间无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
宁波银行股份有限公司	1,938,776.78	18,698.66	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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

博远鑫享三个月债券A

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2022-01-26	2022-01-26	0.450	6,350,436.78	792,268.93	7,142,705.71	-
2	2022-03-02	2022-03-02	0.300	4,152,946.17	727,312.22	4,880,258.39	-
合计			0.750	10,503,382.95	1,519,581.15	12,022,964.10	-

博远鑫享三个月债券C

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
----	-----------	-----	-----------------	--------------	---------------	--------------	----

1	2022-01-26	2022-01-26	0.450	269,865.74	2,360,872.50	2,630,738.24	-
2	2022-03-02	2022-03-02	0.300	170,434.27	1,738,583.93	1,909,018.20	-
合计			0.750	440,300.01	4,099,456.43	4,539,756.44	-

博远鑫享三个月债券E

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2022-01-26	2022-01-26	0.450	2,874,090.70	45,026.33	2,919,117.03	-
2	2022-03-02	2022-03-02	0.300	1,916,060.48	31,315.39	1,947,375.87	-
合计			0.750	4,790,151.18	76,341.72	4,866,492.90	-

**6.4.12 期末（2022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**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**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2022年06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27,552,528.44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
102101952	21中电海康MT N001	2022-07-01	103.54	84,000	8,697,014.79
102280416	22信达投资MT N001	2022-07-01	103.79	200,000	20,758,273.97
合计				284,000	29,455,288.76

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年06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11,270,655.14元，于2022年07月04日、2022年07月06日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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人宁波银行，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(如适用)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2022年6月30日，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88.65%(2021年12月31日：45.87%)。

#### 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	15,248,432.88	26,962,594.40
合计	15,248,432.88	26,962,594.40

注：未评级债券为国债、短期融资券（含超短期融资券）。

#### 6.4.13.2.2 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	217,330,931.87	113,077,911.33
AAA以下	22,261,902.18	16,174,009.18
未评级	-	101,644,000.00
合计	239,592,834.05	230,895,920.51

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

#### 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。

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 2022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	1,938,776.78	-	-	-	1,938,776.78
存出保证金	1,331,947.29	-	-	-	1,331,947.29
交易性金融资产	131,465,184.05	121,408,888.87	1,967,194.01	51,608,389.96	306,449,656.89
资产总计	134,735,908.12	121,408,888.87	1,967,194.01	51,608,389.96	309,720,380.96
负债					
卖出回购金融资产款	38,823,183.58	-	-	-	38,823,183.58
应付赎回款	-	-	-	409,528.68	409,528.68
应付管理人报酬	-	-	-	90,147.01	90,147.01
应付托管费	-	-	-	22,536.75	22,536.75
应付销售服务费	-	-	-	11,420.29	11,420.29
应交税费	-	-	-	14,716.31	14,716.31
其他负债	-	-	-	90,441.83	90,441.83
负债总计	38,823,183.58	-	-	638,790.87	39,461,974.45
利率敏感度缺口	95,912,724.54	121,408,888.87	1,967,194.01	50,969,599.09	270,258,406.51
上年度末 2021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	541,757.31	-	-	-	541,757.31
存出保证金	256,976.50	-	-	-	256,976.50
交易性金融资产	67,745,504.40	122,402,538.82	67,710,471.69	50,810,794.73	308,669,309.64
应收利息	-	-	-	3,981,070.67	3,981,070.67
应收申购款	-	-	-	2,048.36	2,048.36
资产总计	68,544,238.21	122,402,538.82	67,710,471.69	54,793,913.76	313,451,162.48

负债					
卖出回购金融资产款	9,499,853.50	-	-	-	9,499,853.50
应付管理人报酬	-	-	-	62,657.27	62,657.27
应付托管费	-	-	-	15,664.35	15,664.35
应付销售服务费	-	-	-	21,364.93	21,364.93
应付交易费用	-	-	-	9,127.50	9,127.50
应交税费	-	-	-	6,523.74	6,523.74
应付利息	-	-	-	-1,189.20	-1,189.20
其他负债	-	-	-	165,000.00	165,000.00
负债总计	9,499,853.50	-	-	279,148.59	9,779,002.09
利率敏感度缺口	59,044,384.71	122,402,538.82	67,710,471.69	54,514,765.17	303,672,160.39

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率上升25个基点	-840,596.03	-2,302,033.71
	市场利率下降25个基点	847,224.39	2,344,366.00

#### 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市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：本基金对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 2022年06月30日		上年度末 2021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	51,608,389.96	19.10	50,810,794.73	16.73
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	51,608,389.96	19.10	50,810,794.73	16.73

#### 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	沪深300指数收益率上升 5%	3,265,242.45	3,160,865.56
	沪深300指数收益率下降 5%	-3,265,242.45	-3,160,865.56

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。常见的各层次金融工具举例如下，第一层次：如以活跃市场报价估值的股票投资、股指期货投资、国债期货投资、每日开放申赎/买卖的基金投资等；第二层次：如因新发/增发尚未上市交易而按发行价格/增发价格估值的不限售的股票投资、债券投资等，使用第三方基准服务机构提供的报价估值的在交易所市场或银行间同业市场交易的债券投资、资产支持证券投资等；第三层次：如使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期的股票投资，以及违约债、非指数收益法估值的长期停牌的股票等估值模型中使用不可观察输入值的投资等。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	66,380,963.75	68,660,805.24
第二层次	240,068,693.14	240,008,504.40
第三层次	-	-
合计	306,449,656.89	308,669,309.64

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期持有的金融工具不存在公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期不存在持有非持续以公允价值计量的金融工具的情况。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金本报告期不存在持有不以公允价值计量的金融工具的情况。

#### 6.4.15 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	51,608,389.96	16.66
	其中：股票	51,608,389.96	16.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	254,841,266.93	82.28
	其中：债券	254,841,266.93	82.28
	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	1,938,776.78	0.63
8	其他各项资产	1,331,947.29	0.43
9	合计	309,720,380.96	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	740,802.00	0.27
C	制造业	33,909,272.96	12.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	827,316.00	0.31
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	373,759.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	3,373,013.00	1.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,040,541.00	0.39
J	金融业	3,540,531.00	1.31
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,803,155.00	2.89
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	51,608,389.96	19.10

### 7.2.2 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。

### 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	33,500	7,803,155.00	2.89
2	603606	东方电缆	60,600	4,641,960.00	1.72
3	300896	爱美客	6,300	3,780,063.00	1.40
4	000858	五粮液	17,900	3,614,547.00	1.34
5	002049	紫光国微	17,200	3,263,184.00	1.21
6	601166	兴业银行	123,900	2,465,610.00	0.91
7	688390	固德威	6,873	2,151,317.73	0.80
8	600872	中炬高新	54,200	1,875,862.00	0.69
9	300487	蓝晓科技	28,350	1,729,350.00	0.64
10	600233	圆通速递	74,300	1,514,977.00	0.56
11	600519	贵州茅台	700	1,431,500.00	0.53
12	000933	神火股份	107,300	1,403,484.00	0.52
13	300850	新强联	13,060	1,162,731.80	0.43
14	300687	赛意信息	45,300	1,040,541.00	0.39
15	600703	三安光电	40,300	990,574.00	0.37
16	002120	韵达股份	56,300	960,478.00	0.36
17	688661	和林微纳	15,577	933,996.92	0.35
18	603986	兆易创新	6,500	924,365.00	0.34
19	601006	大秦铁路	136,200	897,558.00	0.33
20	600219	南山铝业	231,700	854,973.00	0.32
21	603019	中科曙光	29,100	844,482.00	0.31
22	600483	福能股份	58,800	827,316.00	0.31
23	601677	明泰铝业	33,200	790,160.00	0.29
24	300782	卓胜微	5,600	756,000.00	0.28
25	601899	紫金矿业	79,400	740,802.00	0.27
26	601318	中国平安	13,800	644,322.00	0.24
27	300776	帝尔激光	3,100	535,680.00	0.20
28	300558	贝达药业	8,400	510,720.00	0.19
29	601601	中国太保	18,300	430,599.00	0.16
30	300685	艾德生物	13,320	426,240.00	0.16
31	688385	复旦微电	6,529	425,625.51	0.16

32	600521	华海药业	16,900	383,630.00	0.14
33	300408	三环集团	12,600	379,260.00	0.14
34	002727	一心堂	16,300	373,759.00	0.14
35	000063	中兴通讯	3,900	99,567.00	0.04

## 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	600585	海螺水泥	5,738,369.00	1.89
2	601318	中国平安	4,568,210.00	1.50
3	600036	招商银行	3,470,247.00	1.14
4	603606	东方电缆	3,376,280.00	1.11
5	601888	中国中免	3,337,119.00	1.10
6	002120	韵达股份	3,135,524.49	1.03
7	601601	中国太保	3,058,994.00	1.01
8	300687	赛意信息	2,990,690.63	0.98
9	601166	兴业银行	2,563,657.00	0.84
10	000858	五粮液	2,319,257.00	0.76
11	603916	苏博特	2,220,365.00	0.73
12	000933	神火股份	1,761,951.00	0.58
13	600233	圆通速递	1,679,671.00	0.55
14	000420	吉林化纤	1,491,966.00	0.49
15	002371	北方华创	1,475,747.00	0.49
16	300487	蓝晓科技	1,408,679.00	0.46
17	002049	紫光国微	1,353,321.00	0.45
18	601677	明泰铝业	1,002,456.00	0.33
19	601006	大秦铁路	995,434.00	0.33
20	601899	紫金矿业	983,005.00	0.32

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	601318	中国平安	5,029,383.30	1.66
2	600585	海螺水泥	4,868,329.45	1.60
3	601888	中国中免	3,223,090.00	1.06
4	300496	中科创达	2,989,108.00	0.98
5	600036	招商银行	2,980,599.00	0.98
6	002241	歌尔股份	2,904,665.50	0.96
7	300896	爱美客	1,990,686.00	0.66
8	601601	中国太保	1,955,462.00	0.64
9	603916	苏博特	1,900,775.00	0.63
10	300601	康泰生物	1,843,212.78	0.61
11	300687	赛意信息	1,834,353.00	0.60
12	002120	韵达股份	1,785,847.00	0.59
13	300416	苏试试验	1,740,639.00	0.57
14	000858	五粮液	1,614,169.00	0.53
15	300059	东方财富	1,596,400.85	0.53
16	001914	招商积余	1,546,966.00	0.51
17	002371	北方华创	1,448,490.00	0.48
18	000420	吉林化纤	1,380,655.00	0.45
19	300580	贝斯特	1,057,349.00	0.35
20	600460	士兰微	993,155.00	0.33

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	65,443,019.90
卖出股票收入（成交）总额	60,645,990.83

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	15,248,432.88	5.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,923,788.49	3.67
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	50,764,597.81	18.78
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	164,131,873.96	60.73
7	可转债(可交换债)	14,772,573.79	5.47
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	254,841,266.93	94.30

### 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	102280416	22信达投资MTN001	200,000	20,758,273.97	7.68
2	102101322	21东方电气MTN002	200,000	20,757,708.49	7.68
3	102101952	21中电海康MTN001	200,000	20,707,178.08	7.66
4	102100521	21广州地铁MTN007	200,000	20,341,041.10	7.53
5	149764	22鲲鹏01	200,000	20,193,909.04	7.47

### 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

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** 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除**21人才安居MTN001(102100437.IB)**、**21华为MTN002(102100344.IB)**、**21广州地铁MTN007(102100521.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**21人才安居MTN001(102100437.IB)**的发行主体深圳市人才安居集团有限公司涉嫌违反法律法规，深圳市宝安区水务局对其处以罚款壹万伍仟元人民币（文件批号：深水政（宝安）罚决字（2021）第115号）。

本基金投资的前十名证券之一的**21华为MTN002(102100344.IB)**的发行主体华为投资控股有限公司因未依法履行职责，收到东莞市纪委监委、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事故责任认定及处理建议的批复。

本基金投资的前十名证券之一的**21广州地铁MTN007(102100521.IB)**的发行主体广州地铁集团有限公司近一年内，因涉嫌违反法律法规，违法占地，未依法履行职责多次受到广州市规划和自然资源局的罚款（文件批号：穗规划资源黄资罚（2021）262号）。

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未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	1,331,947.29

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,331,947.29

#### 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	113011	光大转债	4,123,658.02	1.53
2	110059	浦发转债	4,010,993.35	1.48
3	113044	大秦转债	3,748,326.28	1.39
4	110057	现代转债	352,996.40	0.13
5	110062	烽火转债	301,493.63	0.11
6	113052	兴业转债	219,992.92	0.08
7	123090	三诺转债	161,859.15	0.06
8	128144	利民转债	60,495.09	0.02
9	113050	南银转债	39,258.89	0.01
10	110053	苏银转债	6,298.97	0.00

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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	148	1,134,171.78	157,763,719.35	93.99%	10,093,703.77	6.01%
博远鑫享三个月债券C	69	459,040.79	27,039,938.85	85.37%	4,633,875.36	14.63%
博远鑫享三个月债券E	7	9,277,665.76	63,868,682.31	98.34%	1,074,977.98	1.66%
合计	223	1,185,986.09	248,672,340.51	94.02%	15,802,557.11	5.98%

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

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	博远鑫享三个月债券A	18.58	0.00%
	博远鑫享三个月债券C	-	-

	博远鑫享三个月 债券E	-	-
	合计	18.58	0.00%

注：上述基金管理人的从业人员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）。

### 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	154,208,064.89	57,513,862.50	64,869,267.31
本报告期基金总申购份额	40,547,523.51	9,270,531.73	74,392.98
减：本报告期基金总赎回份额	26,898,165.28	35,110,580.02	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	167,857,423.12	31,673,814.21	64,943,660.29

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开过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.基金管理人重大人事变动情况

本报告期内，本基金管理人于2022年7月2日发布公告，经本基金管理人董事会审议通过，聘任姜俊先生担任本公司财务负责人，任职日期为2022年6月30日。

#### 2.基金托管人重大人事变动情况

本报告期内，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，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘会计师事务所的情况。

### 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、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 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	
平安证券	2	13,066,776.63	10.36%	8,626.80	9.17%	-
中金财富证券	3	113,022,234.10	89.64%	85,443.61	90.83%	-

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，新增平安证券专用交易单元，无其他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
平安证券	36,595,530.49	67.02%	160,741,000.00	28.87%	-	-	-	-
中金财富证券	18,010,204.09	32.98%	396,100,000.00	71.13%	-	-	-	-

## 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	博远基金管理有限公司关于	规定媒介	2022-01-04

	旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告		
2	博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金2021年第四季度报告	规定媒介	2022-01-20
3	博远基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	规定媒介	2022-01-20
4	博远基金管理有限公司旗下基金2021年第4季度报告提示性公告	规定媒介	2022-01-20
5	关于博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金暂停大额申购(含定期定额投资、转换转入)业务的公告	规定媒介	2022-01-24
6	博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金2022年第1次分红公告	规定媒介	2022-01-25
7	关于博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金暂停大额申购(含定期定额投资、转换转入)业务的公告	规定媒介	2022-02-26
8	博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金2022年第2次分红公告	规定媒介	2022-03-01
9	博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金基金经理变更公告	规定媒介	2022-03-09
10	关于博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金招募说明书和基金产品资料概要更新的提示性公告	规定媒介	2022-03-11

11	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	2022-03-11
12	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	2022-03-11
13	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	2022-03-11
14	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(2022年第1号)	规定媒介	2022-03-11
15	博远基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京中植基金销售有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2022-03-16
16	博远基金管理有限公司关于代为履行基金经理职责的公告	规定媒介	2022-03-19
17	博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金2021年年度报告	规定媒介	2022-03-24
18	博远基金管理有限公司关于旗下部分基金2021年年度报告提示性公告	规定媒介	2022-03-24
19	博远基金管理有限公司关于旗下基金参与平安证券股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2022-04-09
20	关于博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金增加平安证券股份有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2022-04-09

21	关于博远基金管理有限公司旗下公开募集证券投资基金风险等级划分结果的说明	规定媒介	2022-04-14
22	博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金2022年第一季度报告	规定媒介	2022-04-21
23	博远基金管理有限公司旗下基金2022年第1季度报告提示性公告	规定媒介	2022-04-21
24	博远基金管理有限公司关于旗下基金参与中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2022-04-27
25	博远基金管理有限公司关于旗下基金参与中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2022-04-27
26	博远基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定媒介	2022-04-27
27	博远基金管理有限公司关于旗下基金参与宁波银行股份有限公司同业易管家平台费率优惠活动的公告	规定媒介	2022-06-15
28	博远基金管理有限公司关于增加宁波银行股份有限公司同业易管家平台办理旗下基金销售业务的公告	规定媒介	2022-06-15
29	博远基金管理有限公司关于旗下基金参与北京雪球基金销售有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2022-06-29

30	博远基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京雪球基金销售有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2022-06-29
----	--	------	------------

## §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	20220307-20220331 20220401-20220523 20220606-20220630	55,406,846.48	0.00	0.00	55,406,846.48	20.95%
产品特有风险							
<p>(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取得赎回变现金额。</p> <p>(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可能引起基金份额净值发生波动，管理费、托管费、某一类基金份额销售服务费等运作费用的计提也可能造成基金份额净值或其中某类基金份额净值的大幅下跌。</p> <p>(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。</p> <p>(4) 基金面临提前终止的风险 高比例投资者赎回后，可能会导致出现连续五十个工作日基金资产净值低于5000万元或基金份额持有人不足20人而触发基金合同应当提前终止的情形。</p>							

### 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  
二〇二二年八月二十五日