

博时恒旭一年持有期混合型证券投资基金
2021 年第 3 季度报告
2021 年 9 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十七日

§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。

基金托管人上海浦东发展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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 博时恒旭一年持有期混合 |
| 基金主代码 | 010775 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 12 月 16 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,513,159,601.94 份 |
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险和回撤的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金的投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、其他资产投资策略三个部分。其中，本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析互相补充的方法，在股票、债券和现金等资产类之间进行相对稳定的适度配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。本基金资产配置不仅考虑宏观基本面的影响因素，同时考虑市场情绪、同业基金仓位水平的影响，并根据市场情况作出应对措施。本基金进行资产配置时将关注系统性风险，对风险和回撤严格控制，基于既定的投资策略，在充分衡量风险收益比后作出投资决策。股票投资策略方面，本基金将结合定量、定性分析，考察和筛选未被充分定价的、具备增长潜力的个股，建立本基金的初选股票池。在股票投资上，本基金将在符合经济发展规律、有政策驱动的、推动经济结构转型的新的增长点和产业中，以自下而上的个股选择为主，重点关注公司以及所属产业的成长性与商业模式，主要涉及到以下几点，行业选择与配置、竞争力分析、管理层分析、财务指标 |

| | | |
|-----------------|---|------------------|
| | 分析、估值比较、交易策略、港股投资策略。其他资产投资策略有债券投资策略、衍生产品投资策略、流通受限证券投资策略、资产支持证券投资策略、购买信用衍生品规避个券信用风险策略。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×15%+中证港股通综合指数收益率×5%+中债综合财富（总值）指数收益率×75%+银行活期存款利率（税后）×5% | |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。 | |
| 基金管理人 | 博时基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 上海浦东发展银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 博时恒旭一年持有期混合 A | 博时恒旭一年持有期混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 010775 | 010776 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 3,143,287,414.69 份 | 369,872,187.25 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 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日) | |
|----------------|---|----------------|
| | 博时恒旭一年持有期混合 A | 博时恒旭一年持有期混合 C |
| 1.本期已实现收益 | -38,552,499.14 | -4,899,626.17 |
| 2.本期利润 | -35,021,488.13 | -4,485,446.40 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0111 | -0.0121 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,154,713,852.52 | 370,047,114.60 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0036 | 1.0005 |

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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 本报告期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

1. 博时恒旭一年持有期混合A:

| 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 | -1.10% | 0.21% | -0.46% | 0.25% | -0.64% | -0.04% |

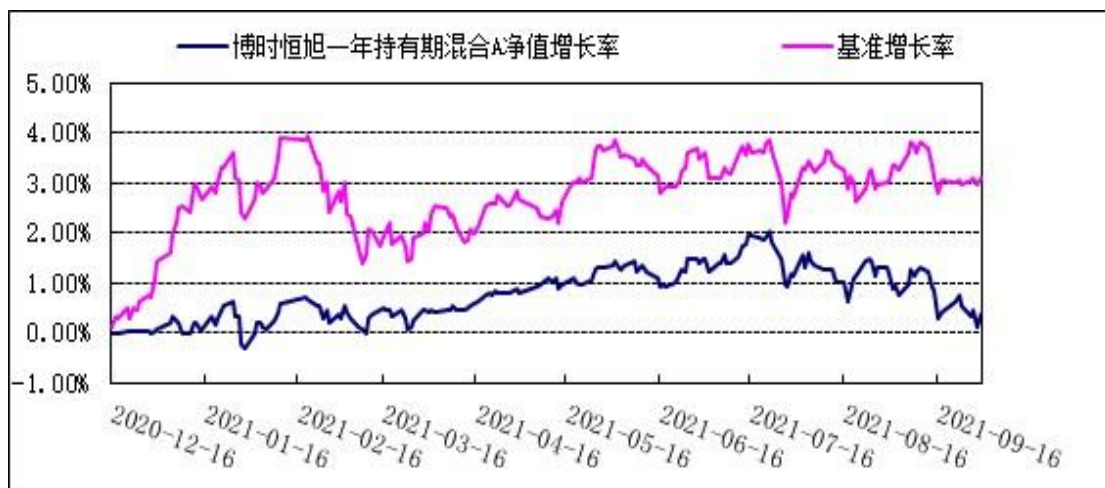
| | | | | | | |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 过去六个月 | -0.07% | 0.16% | 1.05% | 0.22% | -1.12% | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.36% | 0.16% | 3.10% | 0.25% | -2.74% | -0.09% |

2. 博时恒旭一年持有期混合C:

| 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 | -1.19% | 0.21% | -0.46% | 0.25% | -0.73% | -0.04% |
| 过去六个月 | -0.26% | 0.16% | 1.05% | 0.22% | -1.31% | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.05% | 0.16% | 3.10% | 0.25% | -3.05% | -0.09% |

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

1. 博时恒旭一年持有期混合A:



2. 博时恒旭一年持有期混合C:



注：本基金的基金合同于 2020 年 12 月 16 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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 | | |
| 王申 | 固定收益研究部总经理/固定收益研究部研究总监/基金经理 | 2020-12-16 | - | 11.7 | 王申先生，博士。2002 年起先后在友邦保险、申银万国证券、国金证券工作。2013 年加入博时基金管理有限公司。历任固定收益研究主管、固定收益总部研究组副总监、博时锦禄纯债债券型证券投资基金(2016 年 11 月 8 日-2017 年 10 月 19 日)、博时民丰纯债债券型证券投资基金(2016 年 11 月 30 日-2017 年 12 月 29 日)、博时安慧 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2016 年 12 月 16 日-2017 年 12 月 29 日)、博时智臻纯债债券型证券投资基金(2016 年 8 月 30 日-2018 年 3 月 15 日)、博时合惠货币市场基金(2017 年 1 月 13 日-2018 年 3 月 15 日)、博时民泽纯债债券型证券投资基金(2017 年 1 月 13 日-2018 年 3 月 15 日)、博时富嘉纯债债券型证券投资基金(2017 年 1 月 20 日-2018 年 3 月 15 日)、博时汇享纯债债券型证券投资基金(2017 年 2 月 28 日-2018 年 3 月 15 日)、博时丰达纯债债券型证券投资基金(2016 年 11 月 8 日-2018 年 3 月 29 日)、博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 3 月 29 日-2018 年 4 月 23 日)、博时富鑫纯债债券型证券投资基金(2016 年 11 月 17 日-2018 年 7 月 16 日)、博时富腾纯债债券型证券投资基金(2017 年 6 月 27 日-2018 年 7 月 16 日)、博时盈海纯债债券型证券投资基金(2017 年 8 月 14 日-2018 年 7 月 19 日)、博时新财富混合型证券投资基金(2015 年 6 月 24 日-2018 年 8 月 9 日)、博时鑫禧灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 9 月 26 日-2018 年 9 月 27 日)、博时富祥纯债债券型证券投资基金(2018 年 10 月 29 日-2019 年 12 月 16 日)、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金(2016 |

| | | | | |
|----|------|------------|---|---|
| | | | | <p>年 12 月 7 日-2020 年 6 月 4 日)、博时鑫泰灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 12 月 29 日-2020 年 6 月 4 日)、博时富进纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2019 年 12 月 19 日-2021 年 1 月 27 日)、博时富洋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2020 年 1 月 15 日-2021 年 1 月 27 日)、博时富灿纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2020 年 3 月 26 日-2021 年 4 月 13 日)的基金经理、固定收益总部研究组负责人、研究组总监、博时富盛纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2020 年 7 月 16 日-2021 年 8 月 17 日)基金经理。现任固定收益研究部总经理兼固定收益研究部研究总监、博时宏观回报债券型证券投资基金(2015 年 5 月 22 日—至今)、博时乐臻定期开放混合型证券投资基金(2019 年 10 月 14 日—至今)、博时天颐债券型证券投资基金(2020 年 2 月 24 日—至今)、博时平衡配置混合型证券投资基金(2020 年 2 月 24 日—至今)、博时恒裕 6 个月持有期混合型证券投资基金(2020 年 5 月 18 日—至今)、博时恒进 6 个月持有期混合型证券投资基金(2020 年 12 月 1 日—至今)、博时恒旭一年持有期混合型证券投资基金(2020 年 12 月 16 日—至今)的基金经理。</p> |
| 陈伟 | 基金经理 | 2021-07-21 | - | <p>8.2</p> <p>陈伟先生，硕士。2013 年从清华大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、研究员兼基金经理助理、高级研究员兼基金经理助理、资深研究员兼基金经理助理、资深研究员兼投资经理。现任博时睿远事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2019 年 10 月 30 日—至今)、博时恒康一年持有期混合型证券投资基金(2020 年 12 月 30 日—至今)、博时弘泰定期开放混合型证券投资基金(2021 年 4 月 13 日—至今)、博时恒盛一年持有期混合型证券投资基金(2021 年 4 月 13 日—至今)、博时恒旭一年持有期混合型证券投资基金(2021 年 7 月 21 日—至今)的基金经理。</p> |

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业

协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 10 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来，在经济复苏、疫情反复、通胀预期、流动性拐点预期等多因素的交织影响下 A 股市场波动加剧，由于估值的极致分化，行情在食品医药、新能源、高科技、顺周期、中小市值等多板块间进行了反复的再平衡，不同风格的投资者都面临着阶段性挑战。同时，量化基金的参与改变了市场微观交易结构，进一步加剧了市场波动和情绪起伏。三季度 A 股行情分化非常极致，受产业政策的影响非常大。在能耗双控的政策背景下，以煤炭钢铁有色为代表的供给类资产涨幅超过 20%，而以消费和制造业为代表的需求类资产则大幅下跌。同时，“双减”、反垄断、共同富裕等政策的出台，大幅降低了市场风险偏好，半导体和互联网等科技股也大幅度下跌。但我依然坚定看好 A 股市场，我认为 A 股的中长期趋势没有发生改变，包含下述几个原因。首先是国家政策红利，以科创板和北交所为例，权益市场面临蓬勃发展的黄金机遇期；权益市场肩负着增加经济活力，改变融资结构，推动经济结构转型升级的重大历史使命。其次是中国资产的全球吸引力在提高，众多行业已经涌现出了一大批具有全球竞争力、具有全球定价权的优秀企业。第三，居民资金从非标、理财、房产等方向流向股票市场的趋势在加速，同时外资加配中国也未结束。四季度而言，在低增长、低利率、低通胀、资产荒的宏观背景下，股票市场仍面临友好的运行环境、存在结构性的投资机会。但是，我认为 A 股躺平的机会已经过去，估值难以进一步扩张，我们要从估值扩张走向盈利驱

动，聚焦盈利增速大于估值扩张逻辑的板块，整体配置走向均衡。在行业选择上，成长方向我会重视碳中和主线下的增量需求、科技创新主线下的国产化、以及高端制造主线下的专精特新；低估值方向我会重视盈利能力向上的运营类资产、以及稳增长背景下的新基建需求。债券方面，3 季度以来在 7 月超预期降准的带动下，收益率在 7 月出现 30 左右的下行，而在 8 月以来债市整体呈现震荡格局。从基本面来看，随着出口动力的减弱、以及在地产骤冷的影响下，后续基本面面临内外需共振的下滑压力，预计这一过程会持续到明年上半年。在基本面支撑下，收益率的上行空间被压制，但考虑到降准之后市场已经比较充分地提前反应了对基本面和流动性的预期，在当前位置下我们判断收益率进一步大幅下行的可能性不大。而在基本面压力逐步显现的同时，可以预见到 4 季度到明年上半年逐步会看到政策对冲的信号出现。因此从这个角度看，我们认为当前债市已经比较充分地反应了基本面和货币政策的利好，而对于后续的政策对冲和逐步开始边际宽信用还缺乏定价。我们认为在未来一段时间债市收益率会在底部区间继续震荡，而随着年底到明年上半年宽信用的逐步展开，收益率有一定程度的上行压力。基于此，我们在久期上会比较灵活而不会大幅拉长久期，同时在信用债配置上继续严控相关信用风险。转债方面，我们认为当前情况下转债性价比较低，需要等待市场给出性价比更好的时点。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 09 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0036 元，份额累计净值为 1.0036 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0005 元，份额累计净值为 1.0005 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 -1.10%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 -1.19%，同期业绩基准增长率为 -0.46%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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 | 187,494,089.47 | 5.18 |
| | 其中：股票 | 187,494,089.47 | 5.18 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,936,440,400.06 | 81.07 |
| | 其中：债券 | 2,897,399,700.06 | 79.99 |
| | 资产支持证券 | 39,040,700.00 | 1.08 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 293,500,000.00 | 8.10 |
| | 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 | 154,791,876.27 | 4.27 |
| 8 | 其他各项资产 | 50,018,225.21 | 1.38 |
| 9 | 合计 | 3,622,244,591.01 | 100.00 |

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 10,208,275.59 元，净值占比 0.29%。

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 | 40,899.58 | 0.00 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 150,680,758.55 | 4.27 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,418,442.23 | 0.18 |
| E | 建筑业 | 38,297.80 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 261,174.67 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 11,353,967.87 | 0.32 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 7,336,918.78 | 0.21 |
| J | 金融业 | 61,091.22 | 0.00 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 930,984.57 | 0.03 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 126,629.53 | 0.00 |
| 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 | 36,649.08 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 177,285,813.88 | 5.03 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|------|---------------|--------------|
| 电信业务 | 10,208,275.59 | 0.29 |
| 合计 | 10,208,275.59 | 0.29 |

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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 | 600487 | 亨通光电 | 2,597,912 | 35,851,185.60 | 1.02 |
| 2 | 601012 | 隆基股份 | 224,980 | 18,556,350.40 | 0.53 |
| 3 | 000063 | 中兴通讯 | 510,200 | 16,902,926.00 | 0.48 |
| 4 | 300750 | 宁德时代 | 22,115 | 11,626,518.95 | 0.33 |
| 5 | 002120 | 韵达股份 | 585,809 | 11,276,823.25 | 0.32 |
| 6 | 002466 | 天齐锂业 | 104,700 | 10,635,426.00 | 0.30 |
| 7 | 0941 | 中国移动 | 261,000 | 10,208,275.59 | 0.29 |
| 8 | 601615 | 明阳智能 | 394,600 | 9,845,270.00 | 0.28 |
| 9 | 600585 | 海螺水泥 | 227,100 | 9,265,680.00 | 0.26 |
| 10 | 600019 | 宝钢股份 | 945,000 | 8,221,500.00 | 0.23 |

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 | 182,149,603.20 | 5.17 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 403,818,000.00 | 11.46 |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 361,324,000.00 | 10.25 |
| 5 | 企业短期融资券 | 950,492,500.00 | 26.97 |
| 6 | 中期票据 | 344,871,000.00 | 9.78 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 363,224,596.86 | 10.30 |
| 8 | 同业存单 | 291,520,000.00 | 8.27 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,897,399,700.06 | 82.20 |

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 | 112109106 | 21 浦发银行 CD106 | 2,000,000 | 194,340,000.00 | 5.51 |
| 2 | 019649 | 21 国债 01 | 1,820,040 | 182,149,603.20 | 5.17 |
| 3 | 175606 | 21 腾越 01 | 1,500,000 | 150,570,000.00 | 4.27 |
| 4 | 102100165 | 21 岳阳建投 MTN001 | 1,000,000 | 102,100,000.00 | 2.90 |
| 5 | 042100094 | 21 太湖新城 CP002 | 1,000,000 | 100,620,000.00 | 2.85 |

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

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比(%) |
|----|--------|---------|------------|---------------|-------------|
| 1 | 179278 | 光耀 04A | 260,000.00 | 26,023,400.00 | 0.74 |
| 2 | 168529 | 时宁 01 优 | 100,000.00 | 9,993,000.00 | 0.28 |

| | | | | | |
|---|--------|--------|-----------|--------------|------|
| 3 | 137557 | 旭日 09A | 30,000.00 | 3,024,300.00 | 0.09 |
|---|--------|--------|-----------|--------------|------|

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除 21 浦发银行 CD106(112109106)、21 腾越 01(175606)、21 农业银行 CD030(112103030)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。

主要违规事实：2021 年 7 月 16 日，因存在 1、监管发现的问题屡查屡犯；2、配合现场检查不力；3、内部控制制度修订不及时；4、信息系统管控有效性不足；5、未向监管部门真实反映业务数据；6、净值型理财产品估值方法使用不准确；7、未严格执行理财投资合作机构名单制管理；8、理财产品相互交易调节收益；9、使用理财资金偿还本行贷款；10、理财产品发行审批管理不到位等违规行为，中国银行保险监督管理委员会对上海浦东发展银行股份有限公司处以罚款的公开处罚。

主要违规事实：2020 年 12 月 28 日，因存在未经批准超时施工的违规行为，惠州市生态环境局对广东腾越建筑工程有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2021 年 1 月 19 日，因存在 1、发生重要信息系统突发事件未报告 2、制卡数据违规明文留存 3、生产网络、分行无线网络保护不当 4、数据安全较粗放，存在数据泄露风险 5、网络信息系统存在较多漏洞 6、互联网门户网站泄露敏感信息等违规行为，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司处以罚款的处罚。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

5.11.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 371,577.47 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 49,645,122.51 |
| 5 | 应收申购款 | 1,525.23 |

| | | |
|---|-------|---------------|
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 50,018,225.21 |

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 | 113026 | 核能转债 | 74,622,776.90 | 2.12 |
| 2 | 132015 | 18 中油 EB | 41,981,645.50 | 1.19 |
| 3 | 132009 | 17 中油 EB | 36,869,000.00 | 1.05 |
| 4 | 113013 | 国君转债 | 34,732,183.20 | 0.99 |
| 5 | 110073 | 国投转债 | 34,590,933.00 | 0.98 |
| 6 | 118000 | 嘉元转债 | 19,595,699.50 | 0.56 |
| 7 | 113042 | 上银转债 | 18,164,020.20 | 0.52 |
| 8 | 127005 | 长证转债 | 17,504,517.12 | 0.50 |
| 9 | 113043 | 财通转债 | 16,822,821.60 | 0.48 |
| 10 | 110053 | 苏银转债 | 8,486,116.80 | 0.24 |
| 11 | 110071 | 湖盐转债 | 8,214,968.00 | 0.23 |
| 12 | 113615 | 金诚转债 | 8,191,985.10 | 0.23 |
| 13 | 128116 | 瑞达转债 | 8,100,668.40 | 0.23 |
| 14 | 127020 | 中金转债 | 7,923,321.60 | 0.22 |
| 15 | 128109 | 楚江转债 | 4,537,887.20 | 0.13 |
| 16 | 128029 | 太阳转债 | 3,183,070.80 | 0.09 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 博时恒旭一年持有期混合A | 博时恒旭一年持有期混合C |
|----------------|------------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 3,143,122,773.07 | 369,843,187.40 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 164,641.62 | 28,999.85 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - | - |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 3,143,287,414.69 | 369,872,187.25 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2021 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理 296 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 16138 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 4752 亿元人民币，累计分红逾 1509 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

其他大事件

2021 年 9 月 28 日，由中国证券报社有限公司主办的第十八届中国基金业金牛奖评选结果正式揭晓，凭借出色的业绩以及卓越的投资实力，博时信用债纯债债券一举荣获了“五年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2021 年 9 月 27 日，由证券时报报社有限公司主办的第十六届中国基金业明星基金奖正式公布，凭借出色的业绩以及卓越的投资实力，博时天颐债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。

2021 年 9 月，由北京济安金信科技有限公司主办的第三届济安“群星汇”评选结果揭晓，凭借卓越的综合管理实力和旗下基金产品出色的长期业绩，博时基金一举获得了“济安众星奖”、“济安五星奖”两项重量级的公司奖项。博时旗下产品博时合惠货币（004841）获得了“基金产品单项奖-货币型”，博时合惠货币基金经理魏桢则荣获了“五星基金明星奖”奖。

2021 年 7 月 6 日，由上海证券报社有限公司主办的第十七届“金基金”奖的评选结果揭晓。凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金荣获 2019 年度金基金·海外投资回报基金管理公司奖。博时旗下基金产品博时新起点灵活配置混合型证券投资基金获得 2019 年度金基金·灵活配置型基金三年期奖。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时恒旭一年持有期混合型证券投资基金设立的文件
- 9.1.2 《博时恒旭一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时恒旭一年持有期混合型证券投资基金托管协议》
- 9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 9.1.5 报告期内博时恒旭一年持有期混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二一年十月二十七日