

**博时新收益灵活配置混合型证券投资基金**  
**2021 年第 4 季度报告**  
**2021 年 12 月 31 日**

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年一月二十四日

## §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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 20 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	博时新收益混合
基金主代码	002095
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 2 月 4 日
报告期末基金份额总额	513,055,415.45 份
投资目标	本基金通过对多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期持续稳定的投资回报。
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，资产配置策略主要是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。股票投资以定性和定量分析为基础，从基本面分析入手，根据对市场趋势的判断、宏观经济环境等因素，对成长与价值股的投资比例进行配置。总体而言，成长股与价值股在股票资产中进行相对均衡的配置，适度调整，以控制因风格带来的投资风险，降低组合波动的风险，提高整体收益率。其他资产投资策略有债券投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略，其中，债券投资策略包括期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、可转换债券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博时新收益混合 A	博时新收益混合 C
下属分级基金的交易代码	002095	002096
报告期末下属分级基金的份额总额	342,983,550.87 份	170,071,864.58 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 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)	
	博时新收益混合 A	博时新收益混合 C
1.本期已实现收益	-11,705,456.56	-6,337,330.20
2.本期利润	8,876,374.44	4,980,678.67
3.加权平均基金份额本期利润	0.0259	0.0281
4.期末基金资产净值	460,973,960.93	228,054,753.61
5.期末基金份额净值	1.3440	1.3409

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. 博时新收益混合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	1.69%	1.00%	1.44%	0.39%	0.25%	0.61%
过去六个月	10.29%	1.34%	-1.16%	0.51%	11.45%	0.83%
过去一年	23.65%	1.36%	0.30%	0.59%	23.35%	0.77%
过去三年	110.75%	1.07%	38.57%	0.64%	72.18%	0.43%
过去五年	130.98%	0.87%	38.56%	0.59%	92.42%	0.28%
自基金合同 生效起至今	136.04%	0.80%	48.67%	0.59%	87.37%	0.21%

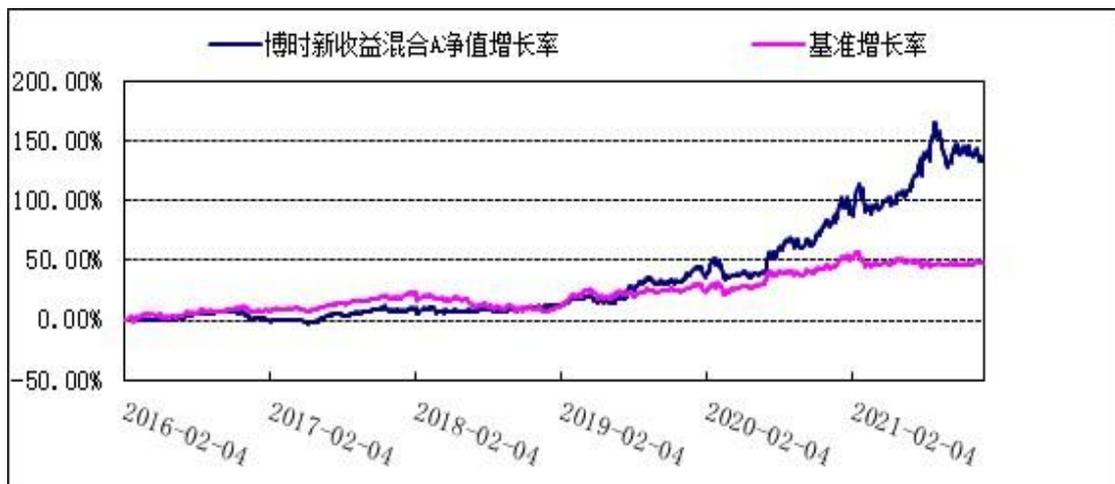
###### 2. 博时新收益混合C:

阶段	净值增长率	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

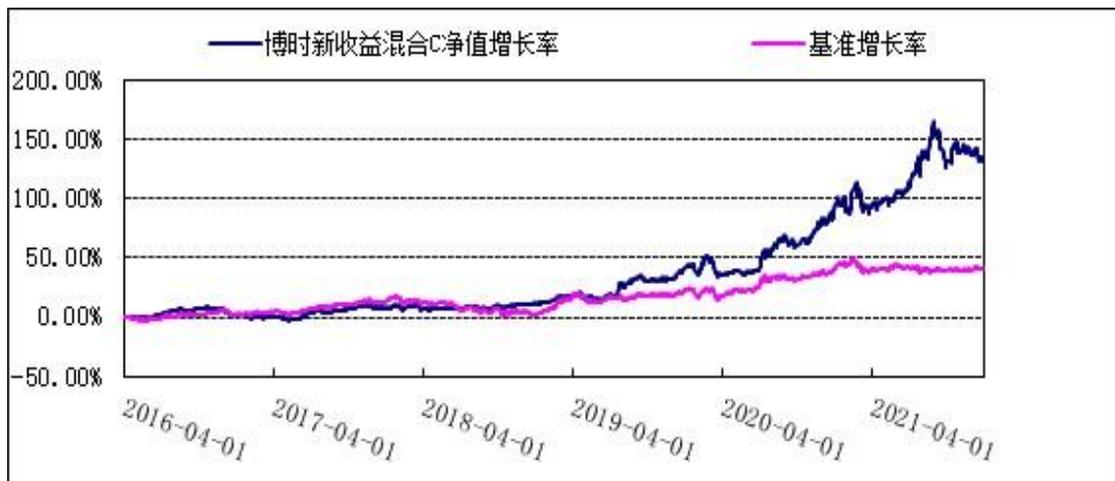
	①	标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	1.66%	1.00%	1.44%	0.39%	0.22%	0.61%
过去六个月	10.23%	1.34%	-1.16%	0.51%	11.39%	0.83%
过去一年	23.52%	1.36%	0.30%	0.59%	23.22%	0.77%
过去三年	110.10%	1.07%	38.57%	0.64%	71.53%	0.43%
过去五年	129.86%	0.87%	38.56%	0.59%	91.30%	0.28%
自基金合同生效起至今	134.82%	0.81%	41.42%	0.58%	93.40%	0.23%

### 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. 博时新收益混合A:



#### 2. 博时新收益混合C:



## §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	说明
----	----	-------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
过钧	首席基金经 理/基金经 理	2016-02-29	-	20.4	过钧先生，硕士。1995 年起先后在上海工艺品进出口公司、德国德累斯顿银行上海分行、美国 Lowes 食品有限公司、美国通用电气公司、华夏基金固定收益部工作。2005 年加入博时基金管理有限公司。历任博时稳定价值债券投资基金(2005 年 8 月 24 日-2010 年 8 月 4 日)基金经理、固定收益部副总经理、博时转债增强债券型证券投资基金(2010 年 11 月 24 日-2013 年 9 月 25 日)、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金(2013 年 2 月 1 日-2014 年 4 月 2 日)、博时裕祥分级债券型证券投资基金(2014 年 1 月 8 日-2014 年 6 月 10 日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2013 年 9 月 13 日-2015 年 7 月 16 日)、博时新财富混合型证券投资基金(2015 年 6 月 24 日-2016 年 7 月 4 日)、博时新机遇混合型证券投资基金(2016 年 3 月 29 日-2018 年 2 月 6 日)、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 8 月 1 日-2018 年 2 月 6 日)、博时稳健回报债券型证券投资基金 (LOF) (2014 年 6 月 10 日-2018 年 4 月 23 日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2016 年 10 月 24 日-2018 年 5 月 5 日)、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 2 月 10 日-2018 年 5 月 21 日)、博时鑫和灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 12 月 13 日-2018 年 6 月 16 日)、博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 1 月 10 日-2018 年 7 月 30 日)的基金经理、固定收益总部公募基金组负责人、博时新价值灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 3 月 29 日-2019 年 4 月 30 日)、博时乐臻定期开放混合型证券投资基金(2016 年 9 月 29 日-2019 年 10 月 14 日)、博时转债增强债券型证券投资基金(2019 年 1 月 28 日-2020 年 4 月 3 日)、博时鑫源灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 9 月 6 日-2020 年 7 月 20 日)、博时新起点灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 10 月 17 日-2020 年 7 月 20 日)、博时鑫瑞灵活配置混合型证券投资

					资基金(2017 年 2 月 10 日-2020 年 7 月 20 日)、博时中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金(2019 年 7 月 19 日-2020 年 10 月 26 日)的基金经理、固定收益总部指数与创新组负责人、公司董事总经理、博时中债 3-5 年进出口行债券指数证券投资基金(2018 年 12 月 25 日-2021 年 8 月 17 日)基金经理。现任首席基金经理兼博时信用债券投资基金(2009 年 6 月 10 日—至今)、博时新收益灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 2 月 29 日—至今)、博时双季鑫 6 个月持有期混合型证券投资基金(2021 年 1 月 20 日—至今)的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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 7 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

临近年底新冠病毒新变种的出现给世界带来不小的惊吓，但随后新药物和疫苗研发紧跟进度以及疫情可能流感化预期给了各国为了经济保持开放更多的信心。市场关注点还是回到了原先的通胀问题：由于天量货币发行和供应链受到贸易战的扰动，美国通胀水平超越了上世纪 70 年代石油危机以来的最高水平，终

于迫使美联储拉下“暂时性”这块遮羞布。我们过去一直强调这次通胀持续程度可能超预期。通胀不会因为你认为暂时性就会暂时性，也不会因为去掉这个表述就表明重视程度的改变，这需要美联储真正做出应对。美债长债收益率的矜持也反映了美联储的信誉受到了侵蚀：TAPER 是启动了，加息也提上了日程，会不会因为某次新的危机而随时改弦易辙？市场需要看到实际行动。“人不会两次踏入同一条河流。”这话固然没错，但是河流的流向一般不会发生改变，过去依旧可以作为未来的指引。美联储已经没有 70 年代高通胀时期的利率工具，也不再会有 Volker 这样真正的通胀斗士。本季度市场利率先上后下，并在 12 月年内第二次降准的带动下创下了年内新低。尽管回顾三季报，我们对社融、政策和通胀的预判的大都得到了实现，但是市场依旧表现强势还是出乎我们意料之外。疫情零星散发和病例动态清零政策，叠加去年的高基数和对“三座大山”的行业整顿，的确对经济尤其是服务业造成影响；但比起人民的生存权，这个代价是值得的。在面对经济问题，中国风险最小化策略和西方收益最大化策略的不同，造成了两者在应对疫情采用完全相反的对策，最终造成了这次货币周期的分化。今年以来的宏观杠杆率同比降幅为过去 10 年最大，也为国家在 22 年稳杠杆奠定了基础。与经济走弱相比，人民币异常的强势还迫使监管出手调降升值预期。随着中国人均 GDP 接近 1.2 万美元，人民币其实已经具有发达和新兴经济体共有的特征，使得中国面对美联储紧缩周期会比其它经济体具有更足的底气，但还是可能会受到一点负面冲击，不太可能无动于衷，取决于宽信用和经济复苏的程度。继今年 9 月份社融见底企稳，国家稳经济宽信用政策预示 2022 年经济增长将走出低谷，在宽货币不变的前提下，收益率曲线未来的变化将取决于宽信用的效果。随着收益率处于较低位置，我们认为已经反应了大多数利好。本基金还是继续维持低久期利率债策略。和利率债类似，在市场资金面宽松情况下，追求收益/回避风险依旧是本季度信用债市场的主题。AA+/AA 级信用利差缩小，低等级信用利差收益率走阔。今年以来，信用债市场违约情况有所企稳，违约家数上升，但违约金额有所下降，违约率保持平稳。与去年国企债违约不同的是，今年的震中变为了民企地产债。民企地产债因为相对高收益和房地产相对安全资质颇得投资者的认可，因此受到打击也相对更大，再次验证在流动性极易缺失的信用债市场分散投资的重要性。而原来一直不温不火的银行二级资本债，则在今年迎来了曙光。地产债的调整减少了高息债的供给，从而引发了二级资本债的行情，也是原来高等级品种收益率过低形势下的选择。REITS 上市后的火爆也同样验证了这一点。我们本季度减持部分地产债，总体保持信用债的低仓位。今年是转债的超预期之年。转债指数以上涨 16% 的表现跑赢几乎各大股票指数，创下历史新高。而转债正股指数则表现更为出色，转债正股的亮眼表现是否可以成为未来 alpha 的来源之一呢？转债发行人为促进转股，有动力做好经营，提高业绩，从而给投资人创造 alpha 奠定基础。市场需求的提升，参与者和发行人队伍的扩大，加上部分发行人友好的赎回决定，增加了市场的流动性。至于估值，除了部分转债品种的高绝对价格和高于正常水平的转股溢价率，如果加上高正股估值，是可能具有较大回撤风险；其余品种需要结合市场整体情况、转债条款和正股估值客观分析。本季度我们小幅减持了部分组合持仓，主要参与一级市场。本季度权

益市场盘整分化，在 4Q 经济走弱的担忧下，主流板块表现一般。随着对经济的担心又到了一个拐点，许多投资者不禁拿 22 年初和 19 年初做对比。与 19 年类似的是，市场处于去杠杆之后稳杠杆的转变期，中央政府部门拥有加杠杆的空间，我们面临的是类似 19 年初的悲观情绪。而与 19 年不同的是：18 年全年大熊市使得权益市场整体估值具有吸引力。在 3 年之后，除了少部分行业估值处于底部，许多行业的估值已然不便宜。22 年宽信用带来的机会将不同于 19 年。过去两年疫情期我国抓紧去杠杆，杠杆同比降幅过去十年最大，在全世界一片放水可谓独一无二。现在拐点已至，我们相信中央的决心。社融企稳回升，经济见底，有助于低估值价值股的表现，同时收益率维持低位，流动性无忧也会支撑部分成长股的估值。即使考虑极端情况，在股市还存在许多估值处于底部的大市值行业情况下，要想出现全面熊市的可能性也较低。本基金本季度调整了部分持仓，增加部分价值股投资，依旧维持权益的高仓位。综上所述，明年一季度，我们判断宽货币加宽信用政策组合将有利于经济数据的企稳。在债券投资上，短期政策潜在利好使得收益率维持低位，但需要警惕利好兑现后的可能调整，毕竟债市静态收益和风险资产相比并不具有太大吸引力；信用债市场同样需要关注高估值资产的风险以及中低等级信用债可能的错杀机会。由于估值处于高位，转债市场将更多的依赖于正股的表现，而非转债自身估值的扩张；拐点期股票资产的表现将更多取决于经济数据的改善幅度，部分旧经济品种将有望有更好的市场表现。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.3440 元，份额累计净值为 2.0130 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.3409 元，份额累计净值为 2.0052 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 1.69%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 1.66%，同期业绩基准增长率为 1.44%。

#### 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	581,146,702.45	77.68
	其中：股票	581,146,702.45	77.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	148,433,267.60	19.84

	其中：债券	148,433,267.60	19.84
	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	9,943,301.34	1.33
8	其他各项资产	8,604,102.52	1.15
9	合计	748,127,373.91	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	41,710,135.80	6.05
C	制造业	355,496,484.43	51.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,817,300.13	0.99
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	413,314.62	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	25,722.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,395,412.75	0.35
J	金融业	130,842,263.20	18.99
K	房地产业	27,543,464.00	4.00
L	租赁和商务服务业	15,358,700.00	2.23
M	科学研究和技术服务业	445,022.88	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	46,489.39	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	29,517.67	0.00
S	综合	-	-
	合计	581,146,702.45	84.34

## 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	300260	新莱应材	1,400,000	66,038,000.00	9.58
2	605358	立昂微	354,567	42,107,410.29	6.11
3	601899	紫金矿业	4,300,014	41,710,135.80	6.05
4	601636	旗滨集团	2,400,992	41,056,963.20	5.96
5	603733	仙鹤股份	976,500	39,850,965.00	5.78
6	601166	兴业银行	2,061,200	39,245,248.00	5.70

7	300400	劲拓股份	1,670,000	38,259,700.00	5.55
8	601009	南京银行	3,914,120	35,070,515.20	5.09
9	000001	平安银行	2,000,000	32,960,000.00	4.78
10	000002	万科 A	1,393,900	27,543,464.00	4.00

#### 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	36,409,570.00	5.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	56,425,200.00	8.19
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,307,300.00	2.80
7	可转债（可交换债）	36,291,197.60	5.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	148,433,267.60	21.54

#### 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	019654	21 国债 06	229,000	22,906,870.00	3.32
2	113013	国君转债	150,000	18,550,500.00	2.69
3	019649	21 国债 01	135,000	13,502,700.00	1.96
4	1980329	19 嵊州债 02	100,000	10,325,000.00	1.50
5	1980328	19 涪陵新区专项债	100,000	10,204,000.00	1.48

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

**5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除兴业银行(601166)、劲拓股份(300400)、平安银行(000001)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 8 月 5 日，因存在 1.违规办理内保外贷业务 2.未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料 3.违反外汇市场交易管理规定 4.未按规定保存交易通讯记录 5.违规办理银行卡业务的违规行为，国家外汇管理局福建省分局对兴业银行股份有限公司处以罚款等行政处罚。2021 年 8 月 20 日，因存在违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定的违规行为，中国人民银行对兴业银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2021 年 9 月 30 日，因存在未及时披露公司重大事项的违规行为，深圳证券交易所对深圳市劲拓自动化设备股份有限公司处以通报批评的处分。

主要违规事实：2021 年 5 月 28 日，因存在利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险;固定资产授信严重不审慎，贷款用途审查监控不到位，贷款资金挪用于借款人母公司归还股票质押融资;流动资金贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人用作银行承兑汇票质押存单;固定资产贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人或借款人关联公司用作银行承兑汇票保证金、购买理财产品等违规行为，中国银行保险监督管理委员会云南监管局对平安银行股份有限公司处以罚款的监管处罚。

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	110,691.92
2	应收证券清算款	5,357,006.59
3	应收股利	-
4	应收利息	2,385,897.40
5	应收申购款	750,506.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,604,102.52

#### 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	113013	国君转债	18,550,500.00	2.69
2	113050	南银转债	10,097,428.80	1.47
3	113047	旗滨转债	2,308,299.20	0.34
4	113049	长汽转债	457,739.10	0.07
5	110079	杭银转债	325,049.40	0.05

6	110053	苏银转债	114,809.20	0.02
7	132020	19 蓝星 EB	79,372.80	0.01
8	113021	中信转债	71,689.20	0.01
9	113034	滨化转债	1,714.10	0.00
10	123116	万兴转债	1,338.20	0.00
11	110067	华安转债	1,166.20	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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	605358	立昂微	6,104,410.29	0.89	非公开发行限售

#### 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	博时新收益混合A	博时新收益混合C
本报告期期初基金份额总额	335,851,297.26	183,106,837.21
报告期期间基金总申购份额	41,979,445.98	75,667,222.19
减：报告期期间基金总赎回份额	34,847,192.37	88,702,194.82
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	342,983,550.87	170,071,864.58

## §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

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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	2021-10-01~2021-12-31	227,201,191.24	-	-	227,201,191.24	44.28%
<b>产品特有风险</b>							
<p>本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20% 的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。</p> <p>本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20% 的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。</p> <p>在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> <p>此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 50% 或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50% 时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。</p>							

## 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 12 月 31 日，博时基金公司共管理 311 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 16687 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 5366 亿元人民币，累计分红逾 1561 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 12 月 15 日，人民银行公示了 2020 年度金融科技发展奖获奖项目，博时基金“新一代投资决策支持系统”荣获二等奖。

2021 年 12 月 1 日，广东省人民政府官网发布《关于 2020 年广东金融创新奖评选结果的通报》，博时基金“新一代投资决策支持系统”荣获三等奖。

2021 年 11 月 20 日，第五届中国海外基金金牛奖评选揭晓，博时基金海外全资子公司博时基金（国际）

有限公司旗下的博时大中华债券基金凭借优异的业绩，荣膺“一年期金牛海外中国债券基金”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新收益灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 9.1.2 《博时新收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时新收益灵活配置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 博时新收益灵活配置混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 9.1.6 报告期内博时新收益灵活配置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

二〇二二年一月二十四日