

---

博时季季享三个月持有期债券型证券投资  
基金

2023 年第 3 季度报告

2023 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

## §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 2023 年 10 月 23 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 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|             |  |            |            |
|-------------|--|------------|------------|
| 基金简称        | 博时季季享持有期   |            |            |
| 基金主代码       | 000783   |            |            |
| 基金运作方式      | 契约型开放式   |            |            |
| 基金合同生效日     | 2019 年 9 月 5 日   |            |            |
| 报告期末基金份额总额  | 7,121,212,139.18 份   |            |            |
| 投资目标        | 在严格控制投资组合风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。  |            |            |
| 投资策略        | 本基金为债券型基金。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相补充的方法，确定资产在固定收益类证券之间的配置比例。本基金灵活应用各种期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略等。本基金将投资组合的平均剩余期限控制在 2 年以内，在控制利率风险、在合理管理并控制组合风险的前提下，最大化组合收益。 |            |            |
| 业绩比较基准      | 中债总财富（1-3 年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率(税后)×20%  |            |            |
| 风险收益特征      | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。   |            |            |
| 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 | 博时季季享持有期 A   | 博时季季享持有期 B | 博时季季享持有期 C |

|                 |                    |                  |                    |
|-----------------|--------------------|------------------|--------------------|
| 下属分级基金的交易代码     | 000783             | 000784           | 007845             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 3,621,418,703.36 份 | 411,273,653.82 份 | 3,088,519,782.00 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<br>(2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日) |                |                  |
|----------------|---|----------------|------------------|
|                | 博时季季享持有期 A                              | 博时季季享持有期 B     | 博时季季享持有期 C       |
| 1.本期已实现收益      | 30,638,471.18                           | 2,720,558.05   | 19,319,800.66    |
| 2.本期利润         | 23,599,455.95                           | 2,016,908.69   | 14,053,242.95    |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0054                                  | 0.0044         | 0.0042           |
| 4.期末基金资产净值     | 4,025,864,903.01                        | 452,616,434.59 | 3,401,574,260.59 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.1117                                  | 1.1005         | 1.1014           |

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（不包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。

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. 博时季季享持有期A:

| 阶段             | 净值增长率<br>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    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 0.47%      | 0.02%         | 0.40%          | 0.02%                 | 0.07%  | 0.00%  |
| 过去六个月          | 1.30%      | 0.02%         | 1.39%          | 0.02%                 | -0.09% | 0.00%  |
| 过去一年           | 2.03%      | 0.03%         | 2.18%          | 0.03%                 | -0.15% | 0.00%  |
| 过去三年           | 8.68%      | 0.02%         | 8.84%          | 0.03%                 | -0.16% | -0.01% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 13.95%     | 0.03%         | 11.58%         | 0.04%                 | 2.37%  | -0.01% |

###### 2. 博时季季享持有期B:

| 阶段    | 净值增长率<br>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   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.39%      | 0.02%         | 0.40%          | 0.02%                 | -0.01% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.14%      | 0.02%         | 1.39%          | 0.02%                 | -0.25% | 0.00% |
| 过去一年  | 1.72%      | 0.03%         | 2.18%          | 0.03%                 | -0.46% | 0.00% |

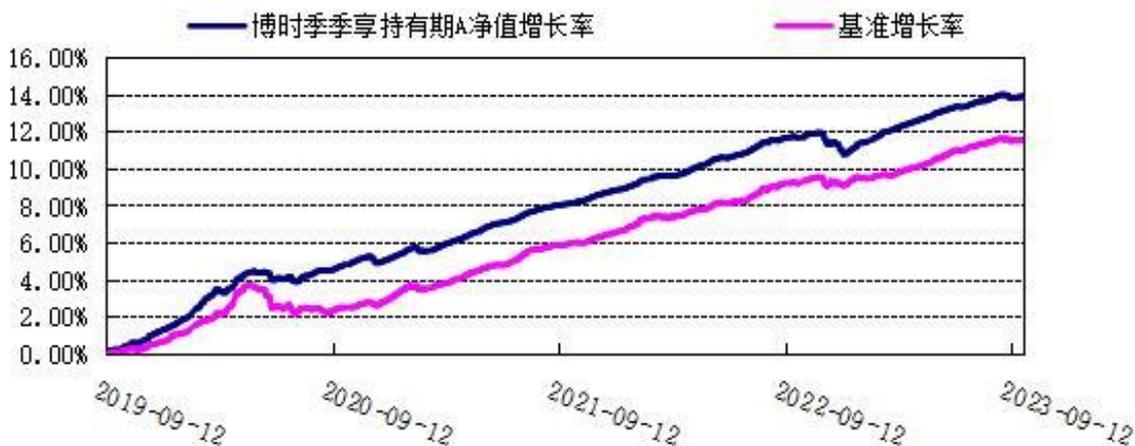
|            |        |       |        |       |        |        |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去三年       | 7.70%  | 0.02% | 8.84%  | 0.03% | -1.14% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 12.61% | 0.03% | 11.58% | 0.04% | 1.03%  | -0.01% |

**3. 博时季季享持有期C:**

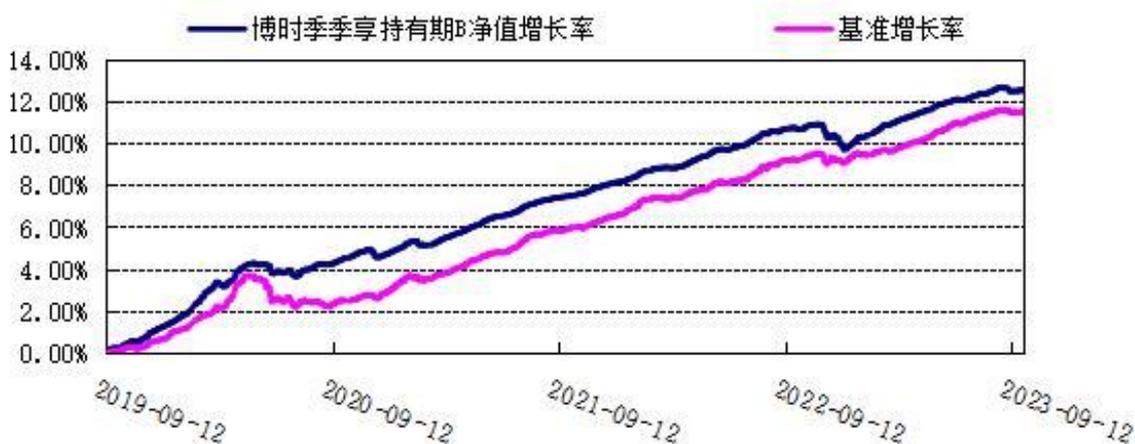
| 阶段         | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 0.38%      | 0.02%         | 0.40%          | 0.02%                 | -0.02% | 0.00%  |
| 过去六个月      | 1.12%      | 0.02%         | 1.39%          | 0.02%                 | -0.27% | 0.00%  |
| 过去一年       | 1.79%      | 0.03%         | 2.18%          | 0.03%                 | -0.39% | 0.00%  |
| 过去三年       | 7.82%      | 0.02%         | 8.84%          | 0.03%                 | -1.02% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 12.66%     | 0.03%         | 11.58%         | 0.04%                 | 1.08%  | -0.01% |

**3.2.2 自基金转型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**

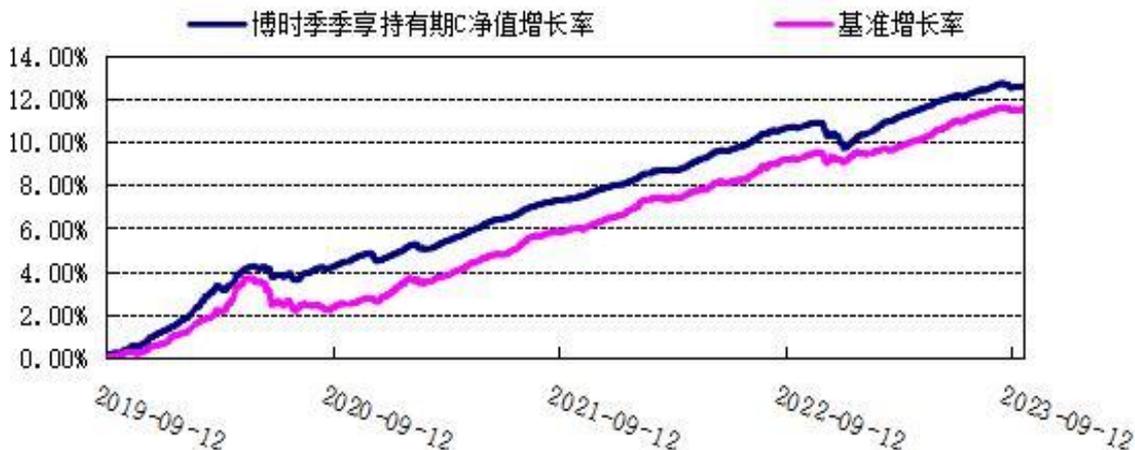
**1. 博时季季享持有期A:**



**2. 博时季季享持有期B:**



**3. 博时季季享持有期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 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|------|-------------|------|--------|--|
|     |      | 任职日期        | 离任日期 |        |  |
| 于渤海 | 基金经理 | 2022-01-24  | -    | 5.4    | 于渤海先生，硕士。2012年起先后在龙江银行股份有限公司、哈尔滨银行股份有限公司、生命保险资产管理有限公司工作。2019年加入博时基金管理有限公司。历任基金经理助理、博时华盈纯债债券型证券投资基金(2021年10月27日-2023年2月10日)、博时民丰纯债债券型证券投资基金(2021年10月27日-2023年5月31日)、博时安仁一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2021年10月27日-2023年7月26日)、博时裕安纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2021年10月27日-2023年7月26日)、博时裕盛纯债债券型证券投资基金(2021年10月27日-2023年7月26日)、博时富华纯债债券型证券投资基金(2021年10月27日-2023年7月26日)的基金经理。现任博时富乾纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基 |

|            |  |                   |          |   |
|------------|--|-------------------|----------|---|
|            |  |                   |          | <p>金(2021年10月27日—至今)、博时广利纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2021年10月27日—至今)、博时聚盈纯债债券型证券投资基金(2021年10月27日—至今)、博时裕发纯债债券型证券投资基金(2021年10月27日—至今)、博时富益纯债债券型证券投资基金(2021年10月27日—至今)、博时季季享三个月持有期债券型证券投资基金(2022年1月24日—至今)、博时信用优选债券型证券投资基金(2022年5月5日—至今)、博时聚瑞纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2022年11月22日—至今)的基金经理,博时富恒纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、博时聚瑞纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、博时富汇纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理。</p>                                |
| <p>黄海峰</p> | <p>固定收益<br/>投资一部<br/>投资总监<br/>助理/基金<br/>经理</p> | <p>2019-09-05</p> | <p>-</p> | <p>13.3</p> <p>黄海峰先生, 学士。2004年起先后在深圳市农村商业银行、博时基金、银华基金、大成基金工作。2016年9月再次加入博时基金管理有限公司。历任博时裕通纯债债券型证券投资基金(2017年5月31日-2018年3月26日)、博时产业债纯债债券型证券投资基金(2017年5月31日-2018年5月30日)、博时盈海纯债债券型证券投资基金(2018年5月9日-2018年7月19日)、博时聚瑞纯债债券型证券投资基金(2017年11月8日-2018年9月3日)、博时富祥纯债债券型证券投资基金(2017年11月16日-2018年11月22日)、博时聚瑞纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018年9月3日-2018年11月22日)、博时裕安纯债债券型证券投资基金(2017年5月8日-2019年1月16日)、博时安荣18个月定期开放债券型证券投资</p> |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>基金(2017 年 6 月 15 日-2019 年 3 月 2 日)、博时富兴纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 4 月 12 日-2019 年 8 月 19 日)、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日-2019 年 9 月 5 日)、博时裕腾纯债债券型证券投资基金(2017 年 5 月 8 日-2020 年 7 月 7 日)、博时裕景纯债债券型证券投资基金(2017 年 5 月 8 日-2020 年 7 月 7 日)、博时裕乾纯债债券型证券投资基金(2017 年 5 月 31 日-2020 年 7 月 7 日)、博时裕鹏纯债债券型证券投资基金(2017 年 12 月 29 日-2020 年 7 月 7 日)、博时民丰纯债债券型证券投资基金(2017 年 12 月 29 日-2020 年 7 月 7 日)、博时富安纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 2 月 2 日-2020 年 7 月 7 日)、博时富乾纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 2 月 8 日-2020 年 7 月 7 日)、博时华盈纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日-2020 年 7 月 7 日)、博时广利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 5 月 28 日-2020 年 7 月 7 日)、博时富和纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日-2020 年 7 月 7 日)、博时裕新纯债债券型证券投资基金(2017 年 5 月 8 日-2020 年 7 月 20 日)、博时裕发纯债债券型证券投资基金(2017 年 5 月 8 日-2020 年 7 月 20 日)、博时富腾纯债债券型证券投资基金(2018 年 5 月 9 日-2020 年 7 月 20 日)、博时丰庆纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日-2020 年 7 月 20 日)、博时富丰纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2019 年 7 月 8 日-2020 年 7 月 20 日)、博时安仁一年定期开放债券型证券投资基金(2017 年 11 月 8</p> |
|--|--|--|--|---|

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>日-2020 年 9 月 8 日)、博时安心收益定期开放债券型证券投资基金(2016 年 12 月 28 日-2021 年 3 月 31 日)、博时聚利纯债债券型证券投资基金(2017 年 11 月 22 日-2021 年 8 月 17 日)、博时信用优选债券型证券投资基金(2020 年 5 月 22 日-2021 年 8 月 17 日)、博时富业纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2021 年 8 月 17 日-2022 年 9 月 9 日)、博时裕通纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 3 月 26 日-2023 年 2 月 1 日)、博时裕乾纯债债券型证券投资基金(2021 年 10 月 27 日-2023 年 2 月 1 日)的基金经理。现任固定收益投资一部投资总监助理兼博时安盈债券型证券投资基金(2017 年 5 月 31 日—至今)、博时聚源纯债债券型证券投资基金(2018 年 11 月 22 日—至今)、博时季季享三个月持有期债券型证券投资基金(2019 年 9 月 5 日—至今)、博时稳欣 39 个月定期开放债券型证券投资基金(2021 年 2 月 25 日—至今)、博时富恒纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2021 年 11 月 25 日—至今)、博时富璟纯债一年定期开放债券型证券投资基金(2021 年 12 月 2 日—至今)、博时富尊纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2022 年 6 月 14 日—至今)、博时安悦短债债券型证券投资基金(2022 年 12 月 27 日—至今)、博时富安纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2023 年 4 月 3 日—至今)、博时富鸿金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金(2023 年 9 月 1 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，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

## 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 61 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

2023 年三季度，宏观基本面维持弱现实，政策、资金面、外部因素持续影响债市，利率整体呈“V”型走势。具体来看，7 月份，跨季后资金面如期转松，DR007 整体低于政策利率 10-20bp，同时经济数据弱于预期，10 年国债收益率在震荡后逐步下行至月内低点 2.59%。7 月 24 日中央政治局会议召开，在维持高质量发展主线的同时，对地产、资本市场表述均更加积极，超市场预期，利率短期内出现大幅调整。8 月上半月，资金面再度宽松，金融数据低于预期，同时央行于 8 月 14 日超预期下调逆回购政策利率 10bp 释放明确宽松信号，10 年国债收益率逐步降至季度内最低点 2.54%。但是，8 月下半月至 9 月，债市行情逐步逆转。地方债发行提速、人民币汇率贬值压力等因素开始对国内流动性和资产定价产生影响，资金面持续偏紧局面超出市场预期。同时，一线城市“认房不认贷”、存量房贷利率调整等政策陆续落地，稳增长预期明显强化。虽然央行于 9 月 14 日宣布降准 25bp，但对债市影响偏中性。这一阶段，机构赎回造成债市阶段性抛售，明显加大了整体利率上行幅度。与低点相比，10 年国债收益率上行 15bp，国股行 1 年同业存单收益率上行 30bp，2 年隐含评级 AA+ 信用债相比于国开利差上行 21bp，短端资产跌幅大于中长端，信用债跌幅大于利率债。

展望后市，四季度债市整体预计偏震荡行情。房地产等政策密集出台后，当前进入政策效果观察期，地产销售、基建产业链等对基本面可能有短期支撑，后续经济走势需要持续观察。地方再融资债将发行，

美债长端利率上升导致人民币汇率持续承压，这些因素继续构成四季度资金面制约因素。不过，央行近期政策表述里指出经济仍面临需求不足，重提逆周期调节，预计四季度货币政策不具备收紧基础。银行理财规模目前保持稳定，自营和理财等机构配置需求仍在，四季度出现去年 11-12 月债市负反馈和赎回潮的概率较低。整体看，债市行情未逆转但利空扰动增多。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 09 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1117 元，份额累计净值为 1.1372 元，本基金 B 类基金份额净值为 1.1005 元，份额累计净值为 1.1242 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.1014 元，份额累计净值为 1.1247 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.47%，本基金 B 类基金份额净值增长率为 0.39%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 0.38%，同期业绩基准增长率为 0.40%。

#### 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              | -                | -            |
|    | 其中：股票             | -                | -            |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 9,254,717,511.80 | 95.43        |
|    | 其中：债券             | 9,254,717,511.80 | 95.43        |
|    | 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          | 417,144,696.50   | 4.30         |
|    | 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      | 3,327,150.21     | 0.03         |
| 8  | 其他资产              | 22,928,138.20    | 0.24         |
| 9  | 合计                | 9,698,117,496.71 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 1,619,463,646.19 | 20.55        |
|    | 其中：政策性金融债 | 552,132,458.82   | 7.01         |
| 4  | 企业债券      | 831,256,960.26   | 10.55        |
| 5  | 企业短期融资券   | 361,472,964.82   | 4.59         |
| 6  | 中期票据      | 5,316,635,136.89 | 67.47        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | 1,125,888,803.64 | 14.29        |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 9,254,717,511.80 | 117.44       |

### 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  | 112303197 | 23 农业银行 CD197 | 2,000,000 | 195,496,153.01 | 2.48         |
| 2  | 112306227 | 23 交通银行 CD227 | 2,000,000 | 195,411,237.70 | 2.48         |
| 3  | 112317207 | 23 光大银行 CD207 | 2,000,000 | 195,391,912.57 | 2.48         |
| 4  | 210202    | 21 国开 02      | 1,790,000 | 183,299,089.59 | 2.33         |
| 5  | 101459002 | 14 营口港 MTN001 | 1,500,000 | 157,939,520.55 | 2.00         |

### 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

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国进出口银行在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会厦门监管局、大连监管局的处罚。中国光大银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局湖北监管局、国家外汇管理局河北省分局的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局、莆田监管分局、国家外汇管理局遵义市分局、中国人民银行安康市分行的处罚。交通银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局宁德监管分局、赤峰银保监管分局、国家外汇管理局聊城市分局、中国人民银行银川中心支行、中国人民银行西安分行的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局、上海银保监局、国家金融监督管理总局重庆监管局、国家外汇管理局吉林省分局、国家外汇管理局白城市中心支局、中国人民银行青岛市分行、中国人民银行福州中心支行、中国人民银行南昌中心支行的处罚。国家开发银行在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会湖北监管局、国家金融监督管理总局山西监管局、国家金融监督管理总局浙江监管局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

### 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   | -             |
| 2  | 应收证券清算款 | 20,720,000.00 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 2,208,138.20  |
| 6  | 其他应收款   | -             |

|   |      |               |
|---|------|---------------|
| 7 | 待摊费用 | -             |
| 8 | 其他   | -             |
| 9 | 合计   | 22,928,138.20 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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                 | 博时季季享持有期A        | 博时季季享持有期B      | 博时季季享持有期C        |
|--------------------|------------------|----------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额       | 4,880,050,077.79 | 478,721,664.30 | 3,383,814,797.91 |
| 报告期期间基金总申购份额       | 218,810,462.08   | 22,173,177.30  | 197,543,971.53   |
| 减：报告期期间基金总赎回份<br>额 | 1,477,441,836.51 | 89,621,187.78  | 492,838,987.44   |
| 报告期期间基金拆分变动份<br>额  | -                | -              | -                |
| 本报告期期末基金份额总额       | 3,621,418,703.36 | 411,273,653.82 | 3,088,519,782.00 |

## §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 2023 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理 356 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 14570 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 5106 亿元人民币，累计分红逾 1884 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。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时季季享三个月持有期债券型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时季季享三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时季季享三个月持有期债券型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时季季享三个月持有期债券型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时季季享三个月持有期债券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  
二〇二三年十月二十五日