

**博时恒耀债券型证券投资基金**  
**2024 年第 2 季度报告**  
**2024 年 6 月 30 日**

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年七月十九日

## §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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 17 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 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 博时恒耀债券  |
| 基金主代码      | 016670  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2022 年 11 月 10 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 136,909,878.86 份  |
| 投资目标       | 本基金在控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现组合资产长期稳健的增值。   |
| 投资策略       | 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、基金和现金等资产类别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。本基金采用的债券等固定收益类资产投资策略包括：期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、可转换债券及可交换债券投资策略等。本基金的投资策略还包括股票投资策略、基金投资策略、国债期货投资策略、流通受限证券投资策略、购买信用衍生品规避个券信用风险策略。 |
| 业绩比较基准     | 中债综合财富（总值）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×5%+中证港股通综合指数（CNY）收益率×5%+银行活期存款利率(税后)×5%  |
| 风险收益特征     | 本基金是债券型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金、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      | 平安银行股份有限公司  |

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 下属分级基金的基金简称     | 博时恒耀债券 A         | 博时恒耀债券 C        |
| 下属分级基金的交易代码     | 016670           | 016671          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 119,029,216.06 份 | 17,880,662.80 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>(2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) |               |
|----------------|---|---------------|
|                | 博时恒耀债券 A                                | 博时恒耀债券 C      |
| 1.本期已实现收益      | -4,458,033.55                           | -665,219.62   |
| 2.本期利润         | 382,498.43                              | 39,035.86     |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0031                                  | 0.0021        |
| 4.期末基金资产净值     | 114,655,968.54                          | 17,125,654.06 |
| 5.期末基金份额净值     | 0.9633                                  | 0.9578        |

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. 博时恒耀债券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          | 0.32%      | 0.34%         | 1.79%          | 0.09%                 | -1.47%  | 0.25% |
| 过去六个月          | 1.07%      | 0.41%         | 3.63%          | 0.10%                 | -2.56%  | 0.31% |
| 过去一年           | -1.22%     | 0.34%         | 4.30%          | 0.10%                 | -5.52%  | 0.24% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -3.67%     | 0.30%         | 7.22%          | 0.10%                 | -10.89% | 0.20% |

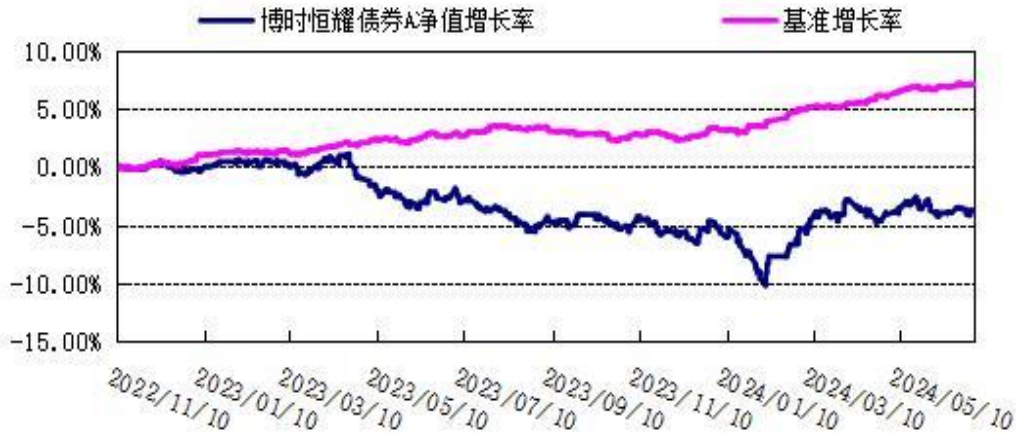
###### 2. 博时恒耀债券C:

| 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 | 0.24%      | 0.34%         | 1.79%          | 0.09%                 | -1.55% | 0.25% |
| 过去六个月 | 0.90%      | 0.41%         | 3.63%          | 0.10%                 | -2.73% | 0.31% |

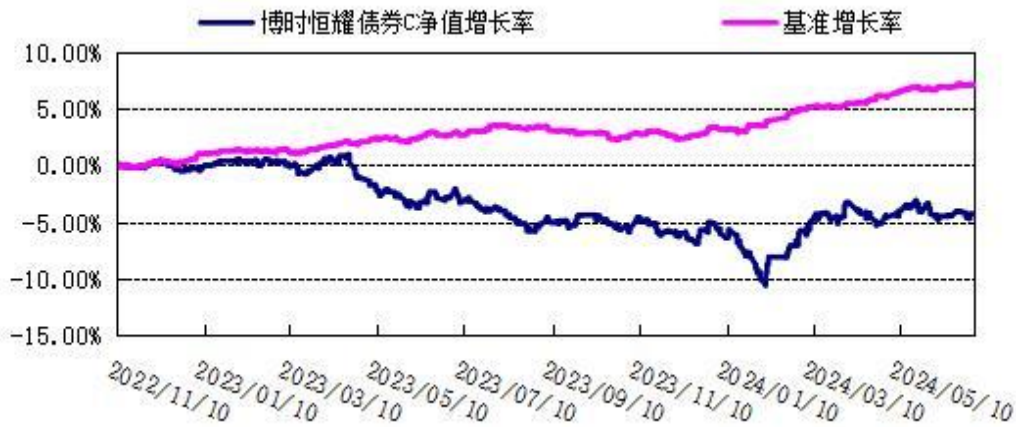
|            |        |       |       |       |         |       |
|------------|--------|-------|-------|-------|---------|-------|
| 过去一年       | -1.56% | 0.34% | 4.30% | 0.10% | -5.86%  | 0.24% |
| 自基金合同生效起至今 | -4.22% | 0.30% | 7.22% | 0.10% | -11.44% | 0.20% |

### 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. 博时恒耀债券A:



#### 2. 博时恒耀债券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 |        |   |
| 过钧 | 首席基金经理/基金经理 | 2022-11-10  | -    | 22.9   | 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 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>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</p> |
|--|--|--|--|---|

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | 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)、博时浦惠一年持有期混合型证券投资基金(2022 年 2 月 17 日—至今)、博时恒耀债券型证券投资基金(2022 年 11 月 10 日—至今)、博时信享一年持有期混合型证券投资基金(2023 年 3 月 8 日—至今)、博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 9 月 15 日—至今)、博时转债增强债券型证券投资基金(2023 年 9 月 15 日—至今)、博时匠心优选混合型证券投资基金(2024 年 4 月 25 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，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 22 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

本季度美联储第六次和第七次维持 5.25-5.5% 的目标利率不变，并把今年的预期降息次数从两次减少到了一次。居高不下的财政赤字和上涨的通胀预期需要更高的风险溢价。大选年的选举压力和中小企业融资贵问题，降息也是迫不得已的选择，因此下半年预计美联储可能利用劳工市场的短期走软而降息，但二次通胀风险可能因此而抬升。如特朗普在今年大选中获胜，他的政治和经济主张可能会导致更高的通胀和财政赤字。24 年美国财年预计赤字将达 1.9 万亿美元，较二月份预测上升 27%。在选举之年，两党控制开支和削减债务的意愿都不强。本季度加拿大和欧洲各国央行都开启降息，超半数 G7 国家货币政策已经转向，瑞士甚至已经连续两次降息，加息周期可能已经结束。但因此带来的美元指数走强又给非美货币带来贬值的压力，人民币兑美元汇率已经触及年内低点。但如果下半年美联储也开启降息之旅，尽管可能是短期的，在二次通胀再度起来之前，美元强势可能会告一段落；与此同时，美国经济软着陆的概率上升，有利于中国的出口链继续成为年内的亮点。

受本季度经济增速有所减缓和数据不及预期情况下，债券市场维持强势，收益率曲线走出牛陡下行走势，中短端收益率下行幅度大于长端。期间经济基本面并未出现大的变化，地产限购大范围放开以及超长期国债发行没有对债市产生大的影响：根据海外经验，地产调整基本上需要 3-5 年时间，现在讨论转向还为时过早，因此债市最担心的利空还未出现。而在规范手工补息背景下，本质也是一种变相的降息：银行体系负债成本的下降，一定程度上可以解释长端利率对权益市场反弹的钝化。上半年经济的亮点在于出口，但影响国内利率的还是内需。短端利率将成为央行主要操作政策利率。在负债端成为债市主要驱动力因素之时，可使央行操作更直接影响市场，体现央行意志。期内中长端利率走势的相对踌躇可能体现了这一点。在二季度经济增速可能低于 5% 情况下，我们还是要提防相关刺激政策出台的突然性。本季度本基金依旧维持利率债短久期策略。

利率债的牛市也影响了信用债市场。本季度各信用利差在低位徘徊，而等级利差，尤其是低等级信用利差则进一步创下历史新低，且处于历史极低水平位置。去年化债之后城投债发行受限，尤其是低等级品种，在资产荒的助力下，的确对信用利差和融资成本下降起到非常大的帮助。上半年表现最好的是低等级长久期信用债，长期信用利差显著收窄。债市资产荒意味着债市核心逻辑转向负债端。在基建大都完成的后工业时代，无论是城投平台还是企业资本支出需求较以往大大减缓，对应的就是高息资产供应的下降，也是这两年债市负债端行情驱动的关键。手工补息取消后，资金转向非银，表内转向表外，非银流动性充裕，其投资偏好影响了市场表现。然而我们依旧认为，类比 22 年 4 季度，尽管当前市场逻辑自洽，一个外部变量的改变在市场极致情况下可能扭转市场预期，只是时点上难以把握，我们能做的还是规避较为昂贵和拥挤的市场。本季度信用债整体依旧低配。

本季度转债市场伴随市场起伏，但各类型转债结构分化明显。随着转债 ETF 份额扩张，大盘权重转债溢价率有所提升，而低价弱质转债则出现下降，市场整体估值水平压缩；而在 6 月之后随着权益市场调整，面值退市频繁发生，叠加部分品种评级大幅下调，低价偏债型转债大量跌破债底，中证转债指数抹去今年涨幅。转债市场加权收益率超过 4%，到达历史极值水平，与红红火火的纯债市场形成鲜明反差。而以大金融转债为主的偏股型转债表现相对抗跌，超额收益明显；偏债和平衡转债的转股溢价率则处于历史较高水平。转债回报最主要的来源来自 1) 正股上涨和 2) 转股溢价率的上升。我们追求的是正股上涨带来的转债转股带来的收益，对债性特征转债报以谨慎态度。我们上期季报也阐明转债高 YTM 可能更多的体现高风险的补偿，不能简单以普通信用债对待。纯债市场经过去年的风险出清，风险溢价大幅下降，而这点在转债市场并未发生。但是，经过本轮下跌，相较普通信用债，转债加权 YTM 比价处于较高水平，部分品种可能会被错杀。本季度我们维持转债零配置。

与债市相反，股市在 2Q 先涨后跌，季末加速调整，几乎所有指数年内都录得负回报，红利股表现突出。强劲外需并未带来企业 CAPEX 的回升，反而会使得财政刺激必要性下降。以前地产企业和城投平台融资行为多为顺周期，经济周期性明显；而现在只有中央政府有能力加杠杆情况下，中央财政加杠杆的意愿成为关键因素，而其逆周期调节方式使得传统周期分析框架有效性和社融指导意义下降。尽管中国中央政府有着主要经济体中最低的杠杆率，但无大力度刺激意愿，所以社会缺少加杠杆主体，也是资本市场追求确定性的主因。不像经济上行周期有大量的正反馈，包括职业上的成功和家庭财富的增值，下行周期情况复杂，许多弊病的暴露和出清考验当局者的智慧。结构转型期往往带来的是成长类资产的下跌和红利类债券资产的上涨。随着避险资产不断上涨，风险资产的吸引力不断上升，“便宜”是我们看好某类资产最好的理由。投资是“反人性”的，任何一种投资策略都不可能十全十美，一旦所有逻辑全都自洽，意味着距离拐点也不远了。本季度我们继续维持权益较高仓位，并调整了部分持仓。

综上所述，二季度经济有所下行，低于我们之前预期，不同大类资产品种也因此走出了与预测相左的走势。展望三季度，逆周期调控使得经济下行可能有底，悲观预期可能在相关会议召开之后有所扭转，制度改革红利相比大规模刺激更符合中国经济当前现状。利率债收益率重回底部，但进一步下行空间依旧有限；随着相关政策效力的过去，信用债极致的估值使得其受突发因素冲击的能力减弱，需要防范相关政策风险。权益市场可能企稳，成长风格可能跑赢；经历大幅调整的部分偏债型品种出现较好的投资机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 0.9633 元，份额累计净值为 0.9633 元，本基金 C 类基金份额净值为 0.9578 元，份额累计净值为 0.9578 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.32%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 0.24%，同期业绩基准增长率为 1.79%。



#### 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              | 26,280,559.80  | 18.96        |
|    | 其中：股票             | 26,280,559.80  | 18.96        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 110,644,858.55 | 79.84        |
|    | 其中：债券             | 110,644,858.55 | 79.84        |
|    | 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      | 1,655,364.78   | 1.19         |
| 8  | 其他各项资产            | 1,009.20       | 0.00         |
| 9  | 合计                | 138,581,792.33 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 11,547,938.00 | 8.76         |
| C  | 制造业              | 14,732,621.80 | 11.18        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -             | -            |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| 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       | -             | -            |
| 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            | 26,280,559.80 | 19.94 |

### 5.2.2 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。

### 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  | 601899 | 紫金矿业 | 446,000 | 7,836,220.00 | 5.95         |
| 2  | 603606 | 东方电缆 | 109,600 | 5,349,576.00 | 4.06         |
| 3  | 300433 | 蓝思科技 | 240,000 | 4,380,000.00 | 3.32         |
| 4  | 000923 | 河钢资源 | 144,900 | 2,495,178.00 | 1.89         |
| 5  | 300260 | 新莱应材 | 100,000 | 2,094,000.00 | 1.59         |
| 6  | 002028 | 思源电气 | 26,500  | 1,772,850.00 | 1.35         |
| 7  | 605358 | 立昂微  | 35,000  | 809,900.00   | 0.61         |
| 8  | 603505 | 金石资源 | 18,000  | 502,740.00   | 0.38         |
| 9  | 002155 | 湖南黄金 | 23,000  | 416,300.00   | 0.32         |
| 10 | 688981 | 中芯国际 | 7,078   | 326,295.80   | 0.25         |

### 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      | 110,644,858.55 | 83.96        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | -              | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 110,644,858.55 | 83.96        |

### 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  | 019733 | 24 国债 02 | 586,000 | 59,228,818.14 | 44.94        |
| 2  | 019727 | 23 国债 24 | 495,000 | 50,400,425.34 | 38.25        |

|   |        |          |        |              |      |
|---|--------|----------|--------|--------------|------|
| 3 | 019709 | 23 国债 16 | 10,000 | 1,015,615.07 | 0.77 |
|---|--------|----------|--------|--------------|------|

## 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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的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内受到公开谴责、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 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |
| 4  | 应收利息    | -        |
| 5  | 应收申购款   | 1,009.20 |

|   |       |          |
|---|-------|----------|
| 6 | 其他应收款 | -        |
| 7 | 待摊费用  | -        |
| 8 | 其他    | -        |
| 9 | 合计    | 1,009.20 |

#### 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 基金中基金

### 6.1 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

### 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目                   | 本期费用 | 其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用 |
|----------------------|------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元）      | -    | -                               |
| 当期交易基金产生的赎回费（元）      | -    | -                               |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | -    | -                               |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | -    | -                               |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | -    | -                               |
| 开放式基金认购手续费           | -    | -                               |
| 基金交易费用(元)            | -    | -                               |

注：上述当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费，是根据被投资基金的实际持仓情况和被投资基金的基金合同约定费率估算得出。该三项费用根据被投资基金的基金合同约定已经作为费用计入被投资基金的基金份额净值，已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金

中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

其中，当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生赎回费金额为 0.00 元，属于按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用。

### 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会等重大影响事件。

## §7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目             | 博时恒耀债券A        | 博时恒耀债券C       |
|----------------|----------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 126,399,119.52 | 21,596,297.53 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 63,048.48      | 976,482.84    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 7,432,951.94   | 4,692,117.57  |
| 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   | 119,029,216.06 | 17,880,662.80 |

## §8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 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。

### 8.2 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。

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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。

## 9.2 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 2024 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 385 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 16037 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 5965 亿元人民币，累计分红逾 2009 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

## §10 备查文件目录

---

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时恒耀债券型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时恒耀债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时恒耀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、博时恒耀债券型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时恒耀债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

### 10.3 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

二〇二四年七月十九日