博时双季鑫 6 个月持有期混合型证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 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	博时双季鑫 6 个月持有期混合
基金主代码	010904
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 20 日
报告期末基金份额总额	48,247,479.75 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，力争实现组合资产长期稳健的增值。
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，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。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。股票投资策略方面，将以价值投资理念为基础，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、资产支持证券投资策略、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、融资业务策略等。		
业绩比较基准	中债-综合财富（总值）指数收益率*75%+沪深 300 指数收益率*20%+活期存款基准利率*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	中信银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	博时双季鑫 6 个月持有期混合 A	博时双季鑫 6 个月持有期混合 B	博时双季鑫 6 个月持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	010904	010924	010905
报告期末下属分级基金的份额总额	25,221,958.77 份	2,395,178.79 份	20,630,342.19 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

	(2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)		
	博时双季鑫 6 个月持有期混合 A	博时双季鑫 6 个月持有期混合 B	博时双季鑫 6 个月持有期混合 C
1.本期已实现收益	498,965.80	42,660.58	379,233.50
2.本期利润	-3,784,012.07	-321,019.15	-3,012,011.57
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1490	-0.1413	-0.1450
4.期末基金资产净值	29,277,392.48	2,733,180.44	23,473,961.49
5.期末基金份额净值	1.1608	1.1411	1.1378

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．博时双季鑫6个月持有期混合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	-11.29%	1.31%	-1.01%	0.22%	-10.28%	1.09%
过去六个月	5.77%	1.11%	1.15%	0.23%	4.62%	0.88%
过去一年	3.65%	0.83%	0.93%	0.21%	2.72%	0.62%
过去三年	19.04%	0.62%	14.86%	0.21%	4.18%	0.41%
过去五年	10.85%	0.50%	16.07%	0.22%	-5.22%	0.28%
自基金合同生效起至今	16.08%	0.48%	16.20%	0.22%	-0.12%	0.26%

2．博时双季鑫6个月持有期混合B：

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	-11.36%	1.31%	-1.01%	0.22%	-10.35%	1.09%
过去六个月	5.61%	1.11%	1.15%	0.23%	4.46%	0.88%
过去一年	3.33%	0.83%	0.93%	0.21%	2.40%	0.62%

过去三年	17.98%	0.62%	14.86%	0.21%	3.12%	0.41%
过去五年	9.20%	0.50%	16.07%	0.22%	-6.87%	0.28%
自基金合同生效起至今	14.11%	0.48%	16.20%	0.22%	-2.09%	0.26%

3．博时双季鑫6个月持有期混合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	-11.38%	1.31%	-1.01%	0.22%	-10.37%	1.09%
过去六个月	5.58%	1.11%	1.15%	0.23%	4.43%	0.88%
过去一年	3.29%	0.83%	0.93%	0.21%	2.36%	0.62%
过去三年	17.80%	0.62%	14.86%	0.21%	2.94%	0.41%
过去五年	8.92%	0.51%	16.07%	0.22%	-7.15%	0.29%
自基金合同生效起至今	13.78%	0.48%	16.20%	0.22%	-2.42%	0.26%

注：自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中债综合财富(总值)指数收益率*75%+沪深 300 指数收益率*15%+恒生综合指数收益率(使用估值汇率调整)*5%+银行活期存款利率(税后)*5%”调整为“中债-综合财富（总值）指数收益率*75%+沪深 300 指数收益率*20%+活期存款基准利率*5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

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

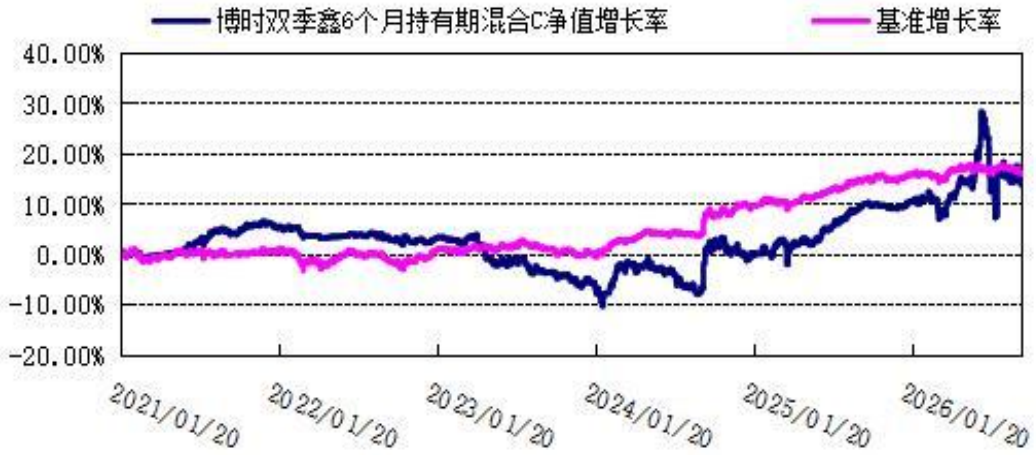
1．博时双季鑫6个月持有期混合A：



2．博时双季鑫6个月持有期混合B：



3．博时双季鑫6个月持有期混合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	2021-01-20	-	25.2	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)、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 11 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

本季度美联储终于按下了加息键。9 月 17 日美联储宣布加息 25 个基点，将联邦基金利率目标区间上调至 3.75%—4.00%，这是自 2023 年 7 月以来首次加息，也标志着 2024 年 9 月开启的降息周期正式结束。加息之后美联储表态偏鹰，但也只有加息才可能重塑美联储的信用。全球的央行都在进入一个紧缩周期，各国债市波动性大幅上升，主要经济体利率大都到达本世纪以来高点。而央行的底气则来自于加息能在控制通胀的同时不对经济产生太大负面影响：相信此轮收益率上升源于财政赤字和 AI 转向债务融资，而通胀可以在短期内得到控制。从周期特征上看，中国经济从利率驱动逐步转向汇率驱动周期。以前人民币汇率升值和中国利率上升正相关，体现中国经济处于上行周期。而今年以来中国利率和汇率的联动脱钩，中美利差达到极致也不能改变人民币升值的趋势。去年人民币升值是在美元指数下跌时达成，而今年则是在美元指数反弹时实现。除了不能完全自由兑换，人民币已经初步具有避险货币的特征；也意味着汇率成为自变量，成为驱动经济周期的重要变量。中国的庞大顺差带来的海外净资产的大幅增加，伴随着地缘政治影响下弃美债买黄金，反映出整个供给和需求结构的变迁，使得美国国债的实际利率不断攀升。相对于抗通胀，如何挽回市场信心、应对 AI 加入军备竞赛对供给的冲击，美联储和财政部最后联手通过 QE 释放流动性以增加市场需求可能也是不得已而为之。反而言之，对于某些发达国家，利率上升叠加汇率贬值的组合则意味着市场对其的信用产生了根本的怀疑。

三季度收益率曲线呈牛平走势，中长期债券收益率下行幅度大于短期品种。以前我们多次提到政府经济工作目标区间的重要性:在总量增长区间确定的前提下，结构变化决定了政策取向和市场表现。市场已经预判完成总量目标的必要性，那么结构上如何达成则更重要。从疫情结束后中国经济的表现来看，净出口恒强带来的增长比重越来越大，相反，内需和投资的重要性相对下降。传统经济学的净出口越强会带来通胀和利率上升的逻辑可能不适用：内需和投资走低反而可能会带来利率的下降。只要满足经济增长目标，

尤其处于区间上限，相关政策即会保持克制和紧缩；反之，如果经济增长处于区间下限，政府也可能会出台内需刺激政策。随着今年以来中国净出口的持续景气，投资和消费较弱，4-8 月份的紧缩性财政政策和宽松货币政策造就了债市今年以来的行情。债券供给期间偏少也加剧了对安全资产需求的失衡。各种利差都在不断压缩。回购利率已经接近 7 天 OMO 利率，而进一步降息可能并不在政策考虑范围内。我们认为随着 9 月份以来发债重启、通胀在四季度进一步上行、以及 GDP 增速有望上修，当前过于极致的做多情绪可能面临调整的可能。期间内本基金继续维持利率债低久期策略。

受利率债市场突破前低利好影响，信用行情整体优于利率，中长债行情表现优于中短端品种，中长端信用利差进一步压缩，资本利得贡献了绝大部分收益。在摊余成本债基重启发行预期影响下，3-5 年普信债买盘强劲，带动信用利差进一步收窄。这几年信用利差持续处于低位，也是我们这几年对债市保持谨慎的重要原因。以前利差处于低位之时，融资成本下降会带动供给的增加，而这几年供给端对利差不做反应，表现为在化债和去杠杆大环境下供给的压降，利差指标失去了应有的弹性。因此利差交易短期内均值回复规律有所失效。城投债未来可能失去政府融资平台资格，而产业债供给则受制于疫情期间的产能扩张后遗症，消化过剩产能也使得信用债失去了供给的弹性。正如我们前面所说，需求变动不大的情况下供给将更重要。在企业还旧账，城投平台压缩的大背景下，政府融资的供给显得尤为重要。本季度初逆周期调节重新提上日程，8 月中旬之后开始落地，9 月发债进度有望重启，可望改变供给不足的状况。在降息可能性不大的情况下，债市经历抢跑之后情绪达到极致，可能在四季度有所退潮。在摊余基金建仓期间，利差可能还是会维持在较低水平。我们本季度还是维持零配信用债品种投资策略。

本季度正股市场冲高回落也带动转债市场下行。由于市场情绪转向谨慎，转债市场之前较高估值加剧了转债市场的调整幅度，转债由前期抗跌转向估值主动消化，年初以来回报跌入负区间。转债市场的较高估值是以 1）纯债市场的低收益率和 2）正股后市走好预期为基础，市场对后市的谨慎情绪自然对转债市场的高溢价造成压缩。转债市场绝对价格依旧处于 17 年以来接近 90%分位数，而估值则跌破了年内低点。从发行人经营业绩上看，由于前期优质转债大都已到期或者转股，剩余品种利润修复弱于营收改善，平均盈利质量弱于整体市场。本季度估值主动消化后估值绝对水位仍处历史偏高分位，转股溢价率中位数处于历史平均水平，资管产品对含权资产配置的增长趋势将在未来为转债市场估值提供长期支撑，这也是纯债收益率处于历史低位市场资金谋求更高回报的选择。随着市场进入四季度，市场情绪可能趋于谨慎，转债市场估值重新扩张短期需要等待。如果前期表现较好的长债调整，风险偏好逆转，转债资产可能有低位反弹的可能。本季度本基金继续仅参与一级市场。

本季度股市出现较大调整：部分行业估值过高和海外动荡导致七月市场自然调整，而后两个月则更多的表现为情绪的波动。如前所述，中国经济进入汇率驱动阶段。在此过程中，汇率的升值对债券和风险资产的影响是相反的。出口导向经济体汇率升值带来企业利润的下行，因此升值往往带来紧缩效应。由于市

场情绪波动，因此此轮中国股市反弹力度不如美国费城半导体指数。今年以来最亮眼的其实要算房地产市场。经过数年调整后的租金回报率已经接近房贷利率，叠加新房供给受限，部分大城市的楼市已经率先企稳，也和我们年初的判断一致。与一手房对投资的带动作用不同，二手房交易时代对消费的提振需要看财富效应的增加，这些还需要假以时日。三季度上市公司业绩可能低于二季度，因此需要更集中在少数业绩能够实现增长的行业和公司上。风格的切换将取决于存量政策是否真正落地、债券收益率的回升以及外围市场的表现。本基金权益仓位也受市场波动影响。我们调整部分持仓，并继续维持权益的较高仓位。

综上所述，本季度资本市场在美联储加息、中东冲突持续和国内政策相机抉择下出现较大波动，市场避险情绪较重，风险资产表现弱于我们之前预期。展望四季度，随着存量政策逐步落地、稳地产政策推出以及通胀逐步回升，降准降息可能性不大，过薄的利差使得债券市场可能机会有限。经过调整后的风险资产在经济数据企稳后部分行业重新具有吸引力，但市场不会重复上半年这种极致行情，投资机会需要更苛刻的审视，经济基本面修复的幅度是关键。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 09 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1608 元，份额累计净值为 1.1608 元，本基金 B 类基金份额净值为 1.1411 元，份额累计净值为 1.1411 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.1378 元，份额累计净值为 1.1378 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-11.29%，本基金 B 类基金份额净值增长率为-11.36%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-11.38%，同期业绩基准增长率为-1.01%。

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	16,247,166.03	25.72
	其中：股票	16,247,166.03	25.72
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	4,170,147.38	6.60
	其中：债券	4,170,147.38	6.60
	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	22,026,830.71	34.88
	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	20,696,241.25	32.77
8	其他资产	18,008.74	0.03
9	合计	63,158,394.11	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	268,110.00	0.48
C	制造业	10,190,373.00	18.37
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	1,908,065.00	3.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,880,618.03	6.99
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	16,247,166.03	29.28

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	301392	汇成真空	27,000	4,001,940.00	7.21
2	688593	新相微	125,627	3,880,618.03	6.99
3	688502	茂莱光学	5,093	2,057,572.00	3.71
4	300873	海晨股份	131,500	1,908,065.00	3.44
5	300260	新莱应材	30,000	1,633,200.00	2.94
6	688605	先锋精科	17,800	1,422,398.00	2.56
7	688037	芯源微	2,500	818,175.00	1.47
8	601899	紫金矿业	9,000	268,110.00	0.48
9	688825	长鑫科技	4,500	246,555.00	0.44
10	920196	南方乳业	400	5,684.00	0.01

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	4,035,790.38	7.27
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）	134,357.00	0.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,170,147.38	7.52

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	019792	25 国债 19	28,000	2,837,437.92	5.11
2	230023	23 附息国债 23	10,000	1,198,352.46	2.16
3	118076	先锋转债	740	131,270.28	0.24
4	113704	春风转债	10	1,705.05	0.00
5	113708	曙 26 转债	10	1,381.67	0.00

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，紫金矿业集团股份有限公司在报告编制前一年受到苏尼特左旗应急管理局的处罚。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约定备选股票库之外的股票。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	16,812.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,196.71
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	18,008.74

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

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	920196	南方乳业	5,684.00	0.01	新股未上市

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	博时双季鑫6个月持有期混合A	博时双季鑫6个月持有期混合B	博时双季鑫6个月持有期混合C
本报告期期初基金份额总额	25,609,112.84	1,710,805.53	19,018,546.99
报告期期间基金总申购份额	1,086,101.86	914,323.30	2,404,980.54
减：报告期期间基金总赎回份额	1,473,255.93	229,950.04	793,185.34
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	25,221,958.77	2,395,178.79	20,630,342.19

§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

单位：份

项目	博时双季鑫 6 个月持有期混合 A	博时双季鑫 6 个月持有期混合 B	博时双季鑫 6 个月持有期混合 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-	2,476,155.54

报告期期间买入/申购总份额	-	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	-	2,476,155.54
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	-	12.00

注：1.申购含红利再投、转换入、级别调整入份额，赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

2.基金管理人博时基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

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	2026-07-01~2026-09-30	10,313,622.69	-	-	10,313,622.69	21.38%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产							

规模持续低于正常运作水平，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。

注：1.申购份额包含红利再投资份额。

2.份额占比为四舍五入后的结果。

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。“创造财富，共赴未来”是公司的使命。公司的投资理念是“投资价值发现者”。截至 2026 年 9 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 406 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 16,913 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,744 亿元人民币，累计分红逾 2,335 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。

§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双季鑫 6 个月持有期混合型证券投资基金设立的文件

2、《博时双季鑫 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》

3、《博时双季鑫 6 个月持有期混合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、博时双季鑫 6 个月持有期混合型证券投资基金各年度审计报告正本

6、报告期内博时双季鑫 6 个月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

二〇二六年十月二十七日