

博时臻选楚汇三个月持有期债券型基金中
基金（FOF）
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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）	
基金主代码	018399	
基金运作方式	契约型 开放式	
基金合同生效日	2023 年 9 月 27 日	
报告期末基金份额总额	162,622,684.31 份	
投资目标	本基金主要采用优选基金策略，在控制风险水平的同时追求基金资产的稳健增值。	
投资策略	本基金将秉承稳健的投资风格，充分发挥基金管理人的资产配置和基金研究经验累积与优势，将大类资产配置，基金研究与筛选以及基金的动态管理三个核心要素有机集合，力争在控制整体下行风险的前提下，实现基金资产的长期稳健增值。本基金主要采取的投资策略有：大类资产配置策略、基金投资策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略等。	
业绩比较基准	中债新综合全价(总值)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*10%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*10%	
风险收益特征	本基金是债券型基金中基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金，低于混合型基金、混合型基金中基金、股票型基金和股票型基金中基金。本基金可通过港股通机制投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因交易规则等差异带来的特有风险。	
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	博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）	博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）

	A	C
下属分级基金的交易代码	018399	018400
报告期末下属分级基金的份额总额	111,510,364.00 份	51,112,320.31 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 (2024年4月1日-2024年6月30日)	
	博时臻选楚汇三个月持有债券 (FOF) A	博时臻选楚汇三个月持有债券 (FOF) C
1.本期已实现收益	476,863.60	53,310.40
2.本期利润	718,606.79	111,634.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0069	0.0044
4.期末基金资产净值	114,417,743.83	52,207,298.11
5.期末基金份额净值	1.0261	1.0214

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. 博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）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	0.68%	0.04%	0.65%	0.07%	0.03%	-0.03%
过去六个月	1.84%	0.03%	2.09%	0.09%	-0.25%	-0.06%
自基金合同 生效起至今	2.61%	0.03%	2.07%	0.09%	0.54%	-0.06%

2. 博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）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	0.52%	0.04%	0.65%	0.07%	-0.13%	-0.03%
过去六个月	1.52%	0.03%	2.09%	0.09%	-0.57%	-0.06%

自基金合同生效起至今	2.14%	0.03%	2.07%	0.09%	0.07%	-0.06%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------

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. 博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）A:



2. 博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）C:



注：本基金的基金合同于 2023 年 9 月 27 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		
张鼎轩	基金经理	2023-09-27	-	11.3	张鼎轩先生，硕士。2013 年起先后在平安罗素投资管理（上海）有限公司（后更名为平安道远）、平安基金、博时资本

					工作。2021年1月加入博时基金管理有限公司。现任博时臻选楚汇三个月持有期债券型基金中基金（FOF）(2023年9月27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

报告期内本基金稳健运作，投资策略方面继续选择“防守中进攻”，在资产配置方面，以债券资产为主要配置方向，二季度债券资产对组合贡献显著，同时通过多资产配置与久期选择，有效规避了四月末债市的调整风险。五月下旬开始转债及权益资产调整较大，择机谨慎逢低参与可转债资产及权益资产的配置，如市场回暖，相关配置的贡献会逐步显现。

投资操作层面上，运作期间密切关注债券收益率曲线变化情况，灵活调配组合中投资的债券基金久期杠杆水平，同时密切关注转债和权益市场的变化情况，谨慎参与市场调整带来的投资机会，期间投资收益不断累积，净值稳步提升，波动与回撤控制优异。

从海外视角来看，美联储的货币政策和地缘政治风险仍是影响全球资本市场，尤其是风险资产的关键因素，欧美大选走势及日元汇率演变成新的不确定变量。美联储降息时点仍分歧较大，地缘政治风险亦难

以预测，因此海外不确定性进一步加大，离岸人民币二季度突破 7.30，人民币汇率走势需要持续重点关注。

国内主要关注经济基本面的改善情况，经济运行延续回升向好态势，高质量发展扎实推进，政治局会议提出的“统筹研究消化存量房产和优化增量住房的政策措施”及后续地产配套政策效果逐步显现，但经济仍面临有效需求不足、社会预期偏弱等挑战，因此基本面进一步改善需要持续跟踪和观察。

组合后续操作中仍坚持选择“防守中进攻”为主要策略，充分发挥债券资产的基础收益价值，积极利用转债资产的“纯债替代”优势，谨慎参与权益资产。

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 1.0261 元，份额累计净值为 1.0261 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0214 元，份额累计净值为 1.0214 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.68%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 0.52%，同期业绩基准增长率为 0.65%。

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	132,348,190.26	77.21
3	固定收益投资	6,811,831.92	3.97
	其中：债券	6,811,831.92	3.97
	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	2,500,255.88	1.46
	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	7,555,206.74	4.41
8	其他各项资产	22,187,429.25	12.94
9	合计	171,402,914.05	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

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

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	6,811,831.92	4.09
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	6,811,831.92	4.09

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	019709	23 国债 16	39,000	3,960,898.77	2.38
2	019727	23 国债 24	28,000	2,850,933.15	1.71

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	3,372.70
2	应收证券清算款	2,500,000.00
3	应收股利	3,127.21
4	应收利息	-
5	应收申购款	19,674,348.19
6	其他应收款	6,581.15
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,187,429.25

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 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

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)	是否属于 基金管理 人及管理 人关联方 所管理的 基金
1	009272	博时信用 优选债券 C	契约型开 放式	14,951,968. 83	16,750,690.6 8	10.05%	是
2	004200	博时富瑞 纯债债券 A	契约型开 放式	11,512,412. 38	12,456,430.2 0	7.48%	是
3	000084	博时安盈 债券 A	契约型开 放式	9,734,990.9 2	12,306,975.5 2	7.39%	是
4	009271	博时信用 优选债券 A	契约型开 放式	9,097,529.1 7	10,261,103.1 5	6.16%	是
5	019067	博时安盈 债券 E	契约型开 放式	6,309,597.8 6	7,972,807.86	4.78%	是
6	009356	博时季季 乐持有期 债券 A	契约型开 放式	7,121,887.7 4	7,841,198.40	4.71%	是
7	016270	博时富鑫 纯债债券 C	契约型开 放式	5,596,057.6 7	6,352,644.67	3.81%	是
8	014846	博时恒乐 债券 A	契约型开 放式	5,766,975.1 1	6,168,933.28	3.70%	是
9	019104	博时安悦 短债 E	契约型开 放式	5,774,836.6 1	6,076,283.08	3.65%	是
10	019480	博时亚洲 票息收益 债券 (QDII)C 人 民币	契约型开 放式	4,158,468.0 0	5,877,578.67	3.53%	是

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)	6,907.98	-

当期交易基金产生的赎回费（元）	6,688.98	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	24,627.24	17,022.28
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	105,387.50	89,031.30
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	29,279.04	24,889.59
开放式基金认购手续费	-	-
基金交易费用(元)	144.76	102.38

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	博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）A	博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）C
本报告期期初基金份额总额	114,308,697.94	22,443,955.36
报告期期间基金总申购份额	17,582,696.24	40,357,758.86
减：报告期期间基金总赎回份额	20,381,030.18	11,689,393.91
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	111,510,364.00	51,112,320.31

§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

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	2024-04-01~2024-06-30	44,999,950.00	-	-	44,999,950.00	27.67 %

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。

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臻选楚汇三个月持有期债券型基金中基金（FOF）设立的文件
- 2、《博时臻选楚汇三个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金合同》
- 3、《博时臻选楚汇三个月持有期债券型基金中基金（FOF）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、博时臻选楚汇三个月持有期债券型基金中基金（FOF）各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时臻选楚汇三个月持有期债券型基金中基金（FOF）在指定报刊上各项公告的原稿

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

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