

# 博时臻选楚汇三个月持有期债券型基金中 基金（FOF）

## 2026 年第 2 季度报告

### 2026 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：二〇二六年七月二十一日

## §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约定，于 2026 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 2026 年 4 月 1 日起至 6 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 | 1,797,213,398.24 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）A                                                                                                       | 博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）C | 博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）B |
| 下属分级基金的交易代码     | 018399                                                                                                                    | 018400              | 022978              |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 38,444,250.92 份                                                                                                           | 1,286,041,529.04 份  | 472,727,618.28 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>(2026 年 4 月 1 日-2026 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 | 博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）B |
| 1.本期已实现收益      | 115,220.59                              | 1,717,118.81        | 1,591,404.79        |
| 2.本期利润         | 147,976.39                              | 4,224,047.73        | 2,596,669.12        |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0036                                  | 0.0027              | 0.0045              |
| 4.期末基金资产净值     | 42,814,692.02                           | 1,408,842,679.93    | 526,262,442.72      |
| 5.期末基金份额净值     | 1.1137                                  | 1.0955              | 1.1132              |

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<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          | 0.23%      | 0.11%         | 1.69%          | 0.13%                 | -1.46% | -0.02% |
| 过去六个月          | 0.41%      | 0.13%         | 1.55%          | 0.12%                 | -1.14% | 0.01%  |
| 过去一年           | 2.81%      | 0.12%         | 2.08%          | 0.11%                 | 0.73%  | 0.01%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 11.37%     | 0.14%         | 7.80%          | 0.11%                 | 3.57%  | 0.03%  |

##### 2. 博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）C:

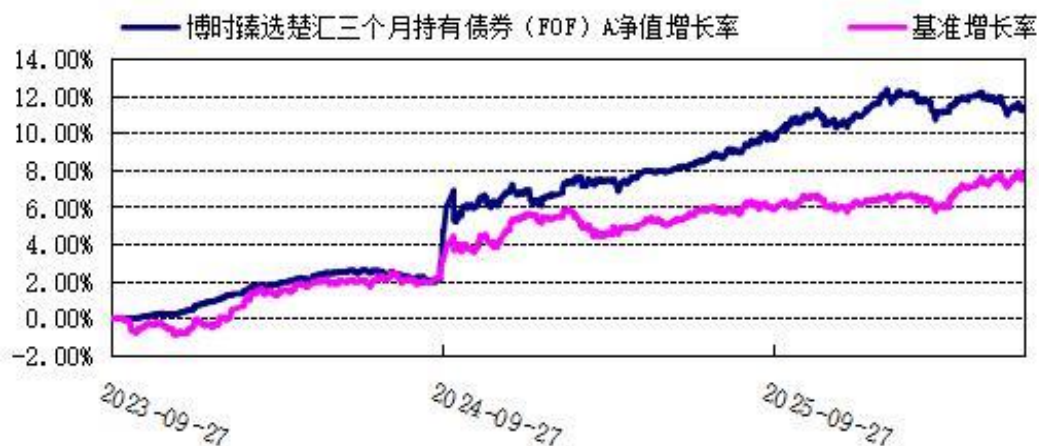
| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 0.08%      | 0.11%         | 1.69%          | 0.13%                 | -1.61% | -0.02% |
| 过去六个月          | 0.11%      | 0.13%         | 1.55%          | 0.12%                 | -1.44% | 0.01%  |
| 过去一年           | 2.19%      | 0.12%         | 2.08%          | 0.11%                 | 0.11%  | 0.01%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 9.55%      | 0.14%         | 7.80%          | 0.11%                 | 1.75%  | 0.03%  |

##### 3. 博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）B:

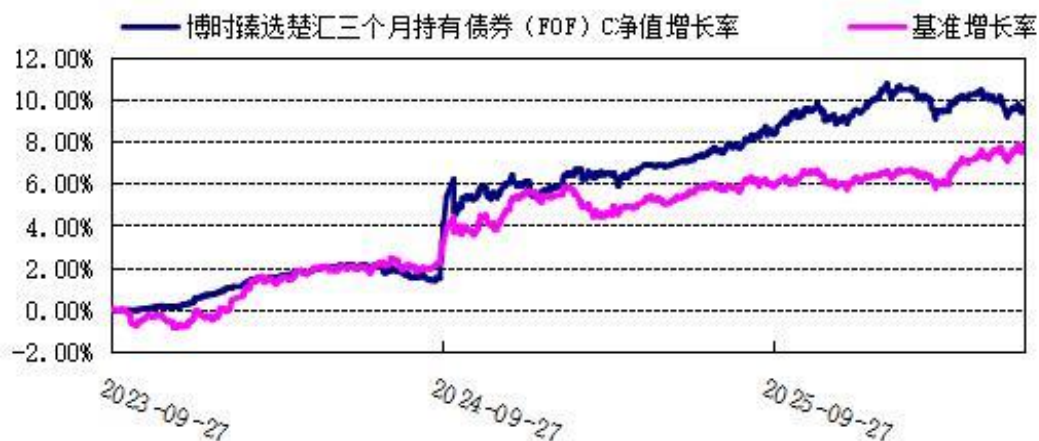
| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 0.23%      | 0.11%         | 1.69%          | 0.13%                 | -1.46% | -0.02% |
| 过去六个月          | 0.41%      | 0.13%         | 1.55%          | 0.12%                 | -1.14% | 0.01%  |
| 过去一年           | 2.81%      | 0.12%         | 2.08%          | 0.11%                 | 0.73%  | 0.01%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 4.15%      | 0.12%         | 2.17%          | 0.10%                 | 1.98%  | 0.02%  |

#### 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

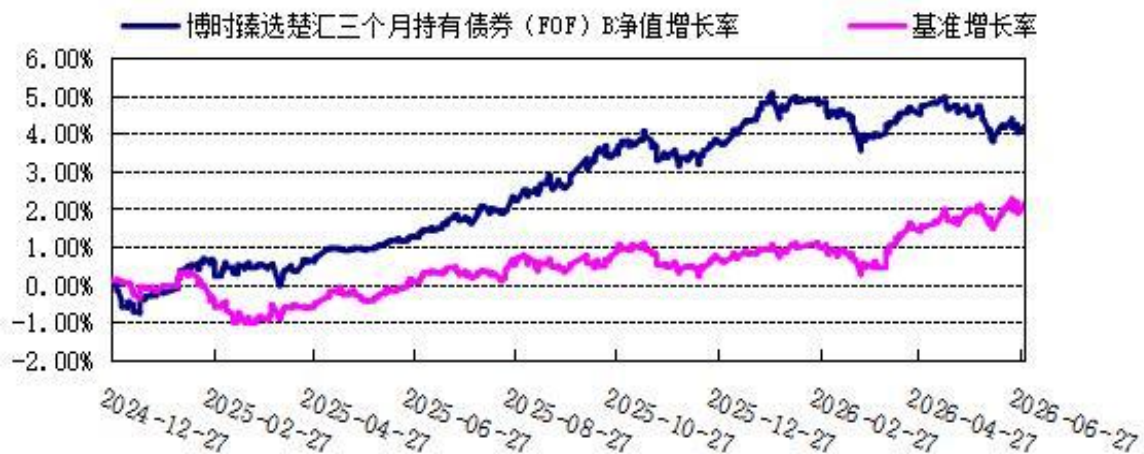
##### 1. 博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）A:



## 2. 博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）C:



## 3. 博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）B:



## §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  | -    | 13.3   | 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)、博时盈泰臻选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）(2026 年 2 月 2 日—至今)、博时恒信臻选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）(2026 年 4 月 8 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 10 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，本基金继续坚持绝对收益导向的投资管理理念，稳健运作，积极把握资本市场投资机会，有效应对市场环境变化，基金净值整体运行平稳，在波动率和回撤控制方面表现良好。二季度，地缘政治仍是全球市场核心变量。随着美伊备忘录签署，市场逐步从“地缘升级—风险重估”转向“冲突缓和—余震仍存”的交易框架。美伊冲突由加剧走向阶段性缓和，霍尔木兹海峡通行预期改善，推动原油风险溢价自高位回落，但战争造成的供给冲击并未迅速消失，市场对增长、通胀和政策路径的再定价仍在持续。海内外市场均呈现较强结构化特征，科技成长表现相对突出，传统顺周期、消费、红利表现相对平淡，战争升级阶段除原油外缺乏稳定有效的对冲工具。海外方面，二季度另一关键变量是市场对美联储重新转向鹰派的担忧升温。6月16日，美联储将联邦基金利率目标区间维持在3.5%至3.75%不变，但政策声明明确表示通胀仍高于2%目标，部分反映供给冲击带来的价格压力。6月会议后，市场定价由年初的降息预期转向重新交易“年内至少加息一次”的可能性，“更久高利率”与“潜在再次加息”的担忧显著抬升，美元指数月末快速升破100。国内方面，二季度经济修复整体偏温和，结构上继续体现明显的“K型经济”特征。6月中国官方非制造业PMI为50.2，较5月小幅回升，显示服务业和建筑业仍处扩张区间，但力度温和，更多体现为弱修复。结合市场表现和微观体感，当前国内宏观环境依然是高技术制造和部分出口链条具备韧性，地产链、居民消费和传统行业偏弱，价格水平与盈利预期修复仍有待进一步验证。从主要指数表现看，A股二季度整体震荡修复，上证综指收于4094.40点，季度上涨5.20%，但并非普涨，而是明显的存量博弈和结构性机会主导。上半年近七成股票下跌，全市场个股涨跌幅中位数低于-15%，高景气科技成长和高端制造具备相对优势，而地产链、传统消费链和多数内需板块仍偏弱，体现为指数温和修复但结构分化加深，投资操作难度显著加大。港股方面，恒生指数收于22881.02点，年内下跌10.73%，恒生科技指数年内下跌18.92%。海外市场，美股韧性较强，但上涨主要集中于科技龙头和AI链条。债券市场在二季度同样面临扰动。外部来看，油价和通胀扰动使海外长端利率的避险属性明显弱化，传统“风险事件利多长债”的逻辑受到挑战。内部来看，在国内基本面、“资产荒”和地缘政治等因素共同推动下，债券资产表现相对占优。但当前收益率绝对水平偏低，且在政策节奏、风险偏好和资金面来回波动之下，债券对权益波动的对冲效果并不稳定。本基金在二季度的投资操作中，延续稳健运作与回撤控制优先的思路，重点提升组合应对突发风险与结构分化行情的能力。针对权益市场，组合继续强调仓位管理、结构配置与交易节奏，但过去长期实践的分散投资波动策略在二季度极致分化行情中面临较大挑战，分散并未体现出明显的控波动优势，对收益提升贡献有限。债券市场表现较好，组合保持了一定久期，有效参与了债券市场投资机会。美以伊冲突爆发后，低配黄金资产从资产配置和风险控制层面对组合形成正向贡献。展望三季度，外围扰动虽较二季度中段有所缓和，但地缘冲突后续影响、油价回落节奏、美国通胀黏性及美联储政策路径仍将持续影响全球资产定

价。若中东局势维持缓和，原油风险溢价有望继续回落，市场对美联储进一步转鹰的担忧也将边际缓释，有利于风险偏好修复；但在通胀尚未充分回落、联储仍对再次加息保持开放的背景下，风险资产估值进一步扩张的空间预计仍将受到约束。国内方面，经济大概率仍延续弱修复、强结构的特征，科技创新、高端制造及部分具备全球竞争力的出口链条仍可能是相对占优方向，而地产、消费和传统行业修复仍需更多政策与收入预期改善来推动。从资产配置角度看，当市场主导变量由需求周期转向供给冲击与地缘事件时，多资产相关性会阶段性抬升，组合稳健性更多依赖情景分析、仓位纪律和动态再平衡，而非简单依赖“静态分散对冲”。债券资产二季度表现较强，主要得益于基本面支撑和“资产荒”，三季度相关因素或将延续，但收益率偏低仍是主要制约因素，进一步下行空间有限，因此需要顺势而为的同时做好风险防范。权益资产在缺乏增量资金背景下仍可能演绎为结构化行情，科技成长仍是确定性较高的景气主线，同时高端制造、有全球竞争力的出口链条和盈利改善、基本面改善的品种有望受益于行情扩散。商品方面，原油价格已回到战前水平，黄金本轮调整也较为充分，当前可重新审视其配置价值及对冲效果，但配置节奏仍需紧密结合事件演变与价格波动水平。从投资操作来看，下半年本基金将继续坚持绝对收益的管理思路，采用稳健的投资策略，继续发挥多资产优势，平衡各类资产投资比例，重视组合回撤控制和持有体验，在复杂环境中努力实现风险与收益的平衡，同时继续应对资产相关性上升带来的组合投资风险。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1137 元，份额累计净值为 1.1137 元，本基金 B 类基金份额净值为 1.1132 元，份额累计净值为 1.1132 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0955 元，份额累计净值为 1.0955 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.23%，本基金 B 类基金份额净值增长率为 0.23%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 0.08%，同期业绩基准增长率为 1.69%。

#### 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              | 1,981,243,104.23 | 83.61  |
| 3 | 固定收益投资            | 115,641,829.76   | 4.88   |
|   | 其中：债券             | 115,641,829.76   | 4.88   |
|   | 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      | 255,182,598.15   | 10.77  |
| 8 | 其他资产              | 17,426,712.27    | 0.74   |
| 9 | 合计                | 2,369,494,244.41 | 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 | 115,641,829.76 | 5.85         |
| 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        | 115,641,829.76 | 5.85 |

### 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  | 102310 | 国债 2513 | 1,142,000 | 115,641,829.76 | 5.85         |

### 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 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 426,712.27    |
| 2  | 应收证券清算款 | 17,000,000.00 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 17,426,712.27 |

### 5.11.3 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。

### 5.11.4 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。

### 5.11.5 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  | 159650 | 博时中债 0-3 年国开行 ETF | 交易型开放式 | 2,645,010.00   | 285,140,013.03 | 14.42%       | 是                      |
| 2  | 008411 | 博时富信纯债债券          | 契约型开放式 | 211,417,160.37 | 234,969,032.04 | 11.88%       | 是                      |
| 3  | 003703 | 博时富鑫纯债债券 A        | 契约型开放式 | 196,626,896.09 | 225,059,145.26 | 11.38%       | 是                      |
| 4  | 004601 | 博时富腾纯债债券          | 契约型开放式 | 183,758,864.07 | 203,678,324.94 | 10.30%       | 是                      |
| 5  | 020024 | 博时信用债纯债债券 B       | 契约型开放式 | 138,065,546.99 | 155,254,707.59 | 7.85%        | 是                      |
| 6  | 004200 | 博时富瑞纯债债券 A        | 契约型开放式 | 117,397,023.17 | 127,270,112.82 | 6.43%        | 是                      |
| 7  | 001961 | 博时裕荣纯债债券          | 契约型开放式 | 79,791,049.53  | 99,611,146.23  | 5.04%        | 是                      |
| 8  | 008170 | 博时富添纯债债券          | 契约型开放式 | 57,042,114.55  | 64,725,687.38  | 3.27%        | 是                      |
| 9  | 018756 | 睿远稳益增强 30 天持有债券 A | 契约型开放式 | 46,608,314.67  | 52,024,200.83  | 2.63%        | 否                      |
| 10 | 008367 | 富国亚洲收益债券 (QDII)   | 契约型开放式 | 46,415,707.39  | 49,265,631.82  | 2.49%        | 否                      |

## 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）      | 6,399.84     | -                               |
| 当期交易基金产生的赎回费（元）      | 53,175.37    | 21,212.28                       |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 208,455.35   | 75,183.61                       |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 2,248,628.77 | 1,518,633.42                    |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 607,021.19   | 459,133.02                      |
| 开放式基金认购手续费           | -            | -                               |
| 基金交易费用(元)            | 31,373.54    | 2,423.31                        |

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 21,212.28 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及大会表决意见等重大影响事件。

## §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 | 博时臻选楚汇三个月持有债券（FOF）B |
|----------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 45,460,133.59       | 1,861,408,050.53    | 692,954,320.70      |
| 报告期期间基金总申购份额   | -                   | -                   | -                   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 7,015,882.67        | 575,366,521.49      | 220,226,702.42      |
| 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   | 38,444,250.92       | 1,286,041,529.04    | 472,727,618.28      |

## §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”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2026 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 404 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 17,353 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 6,993 亿元人民币，累计分红逾 2,312 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

二〇二六年七月二十一日