

**博时荣升稳健添利 18 个月定期开放混合型
证券投资基金
2024 年第 3 季度报告
2024 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年十月二十五日

§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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时荣升稳健添利混合
基金主代码	009144
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 29 日
报告期末基金份额总额	44,019,124.84 份
投资目标	本基金在控制风险的前提下，以绝对收益为核心投资目标，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	<p>（一）封闭期投资策略</p> <p>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，在债券、股票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。本基金资产配置在考虑宏观基本面影响因素的同时考虑市场情绪、同业基金仓位水平的影响，并根据市场情况作出应对措施。</p> <p>本基金投资策略具体包括债券投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略、融资投资策略和流通受限证券投资策略。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。</p>
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×10%+恒生综合

	指数收益率×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产品和货币市场基金，低于股票型基金，属于中等预期风险、中等预期收益的基金产品。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	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博时荣升稳健添利混合 A	博时荣升稳健添利混合 C
下属分级基金的交易代码	009144	009145
报告期末下属分级基金的份额总额	42,407,279.59 份	1,611,845.25 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 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)	
	博时荣升稳健添利混合 A	博时荣升稳健添利混合 C
1.本期已实现收益	-2,458,223.43	-93,524.88
2.本期利润	3,402,440.76	125,365.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0802	0.0778
4.期末基金资产净值	48,059,690.78	1,794,476.44
5.期末基金份额净值	1.1333	1.1133

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. 博时荣升稳健添利混合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	7.62%	0.68%	3.17%	0.18%	4.45%	0.50%
过去六个月	5.17%	0.58%	4.89%	0.15%	0.28%	0.43%
过去一年	0.18%	0.53%	7.10%	0.15%	-6.92%	0.38%
过去三年	2.94%	0.34%	10.45%	0.17%	-7.51%	0.17%

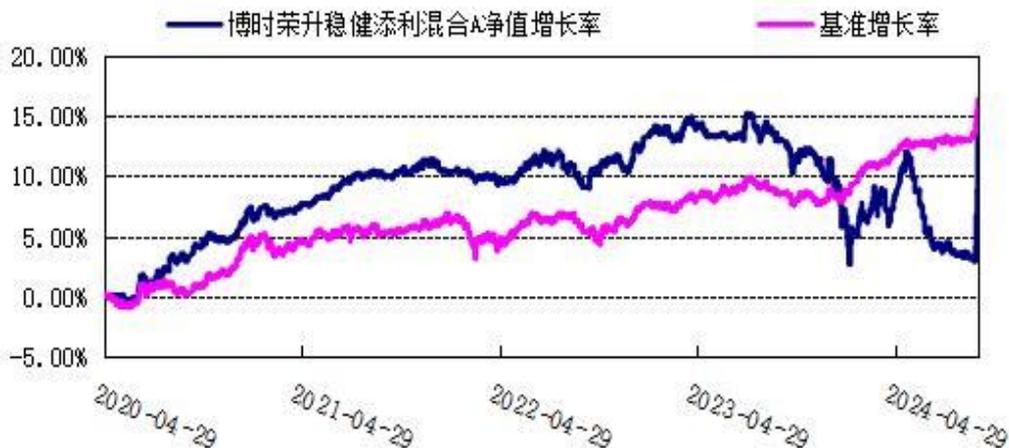
自基金合同生效起至今	13.33%	0.30%	16.40%	0.17%	-3.07%	0.13%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

2. 博时荣升稳健添利混合C:

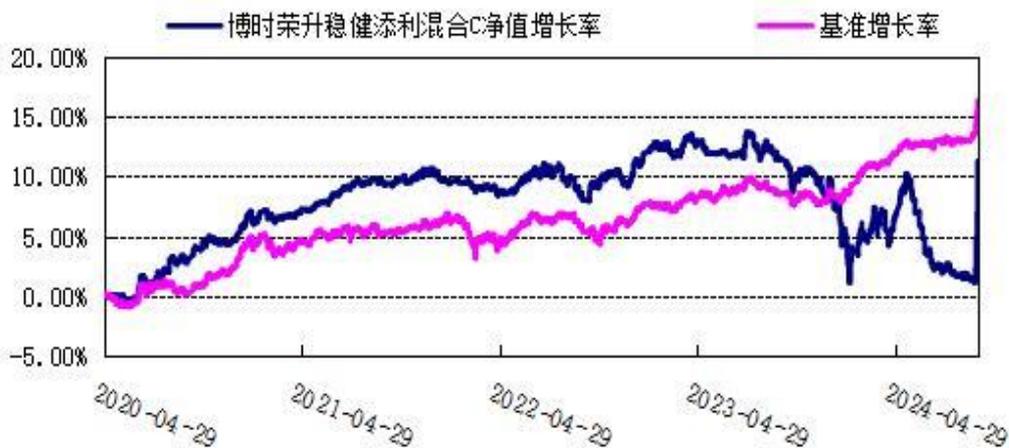
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.51%	0.68%	3.17%	0.18%	4.34%	0.50%
过去六个月	4.96%	0.58%	4.89%	0.15%	0.07%	0.43%
过去一年	-0.22%	0.53%	7.10%	0.15%	-7.32%	0.38%
过去三年	1.71%	0.34%	10.45%	0.17%	-8.74%	0.17%
自基金合同生效起至今	11.33%	0.30%	16.40%	0.17%	-5.07%	0.13%

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. 博时荣升稳健添利混合A:



2. 博时荣升稳健添利混合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		
罗霄	基金经理	2023-03-23	-	12.2	罗霄先生，硕士。2012 年加入博时基金管理有限公司。历任固定收益部研究员、固定收益总部高级研究员、固定收益总部高级研究员兼基金经理助理、年金投资部投资经理、博时恒康一年持有期混合型证券投资基金(2023 年 3 月 1 日-2023 年 7 月 27 日)基金经理。现任博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）(2022 年 9 月 30 日—至今)、博时荣升稳健添利 18 个月定期开放混合型证券投资基金(2023 年 3 月 23 日—至今)、博时稳定价值债券投资基金(2023 年 7 月 28 日—至今)、博时恒瑞混合型证券投资基金(2023 年 9 月 15 日—至今)、博时稳健增利债券型证券投资基金(2023 年 10 月 20 日—至今)、博时恒鑫稳健一年持有期混合型证券投资基金(2024 年 2 月 2 日—至今)、博时天颐债券型证券投资基金(2024 年 2 月 2 日—至今)、博时恒进 6 个月持有期混合型证券投资基金(2024 年 2 月 2 日—至今)、博时宏观回报债券型证券投资基金(2024 年 2 月 2 日—至今)、博时稳合一年持有期混合型证券投资基金(2024 年 4 月 17 日—至今)的基金经理。
李重阳	基金经理	2023-09-15	-	10.2	李重阳先生，硕士。2014 年 7 月至 2015 年 5 月在招商财富工作，2015 年 5 月至 2016 年 9 月在招商证券工作，2016 年 9 月至 2020 年 6 月在建信养老金工作，2020 年 7 月至 2022 年 6 月在南方基金工作，2022 年 7 月加入博时基金管理有限公司。曾任博时恒康一年持有期混合型证券投资基金(2023 年 2 月 8 日-2023 年 7 月 27 日)基金经理。现任博时博盈稳健 6 个月持有期混合型证券投资基金(2023 年 3 月 23 日—至今)、博时鑫荣稳健混合型证券投资基金(2023 年 9 月 15 日—至今)、博时新起点灵活配置混合型证券投资基金(2024 年 3 月 7 日—至今)、博时天颐债券型证券投资基金(2023 年 2 月 7 日—至今)、博时恒玺一年持有期混合

					型证券投资基金(2023 年 2 月 8 日—至今)、博时恒盛一年持有期混合型证券投资基金(2023 年 7 月 26 日—至今)、博时恒悦 6 个月持有期混合型证券投资基金(2023 年 9 月 15 日—至今)、博时荣升稳健添利 18 个月定期开放混合型证券投资基金(2023 年 9 月 15 日—至今)、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金(2023 年 10 月 17 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，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 38 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

三季度债券市场整体呈现较大波动格局。7 月债券市场总体表现较为强势，8 月则由于央行和交易商协会对于部分市场主体实施监管，使得收益率下行的势头放缓，且整体流动性衰减，9 月收益率先下后上，月末相关部门出台一系列政策，推动了市场预期的大幅扭转。权益市场变化较大，经历了 7 月份短期震荡小反弹之后，再次连续两个多月的阴跌，市场平均股价一度接近年初的新低附近。但季末 9.24 政策的变化，导致市场预期的快速转变，指数大幅反弹，消费股率先反弹之后券商和科技股跟上，基本上所有宽基指数

都完成了 20% 以上的涨幅。政策的预期扭转，使市场风险偏好大幅提升，前期超跌估值极度压缩的个股进行快速修复，市场主要体现在超跌反弹特征，主线在后期形成科技主导。

组合权益部分三季度进行了较大的调整，前期进行了止损操作，大幅降低了仓位，9 月开始逐步加回仓位，主要方向是半导体设备、超跌的消费和医药等，转债方面组合在三季度也有一定的调整，在转债信用风险暴露的阶段，组合对于转债仓位先减后加，在流动性冲击接近尾声时加回了转债仓位，先配置了较多的高到期收益率转债，权益市场回暖时又加仓了部分股性更强的转债。

展望未来，债券市场收益率的波动预料会持续放大，且会面临一定的逆风局面，但中长期维度而言债券类资产仍有价值。对于组合而言，在保持一定久期水平的情况下，把握每次调整带来的系统性配置机会，力争为组合增厚收益，提升持有体验。权益市场快速修复后进入震荡分化期，但三季度的悲观风险偏好已经得到了一定的扭转，市场进入相对可为的阶段，后续观察财政政策的力度和方向进行布局，相对看好科技、医药和消费。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 09 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1333 元，份额累计净值为 1.1333 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.1133 元，份额累计净值为 1.1133 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 7.62%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 7.51%，同期业绩基准增长率为 3.17%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在本报告期内出现连续了 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。针对该情形，本基金管理人已向中国证监会报告了解决方案。自 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日，基金管理人自主承担本基金的审计费、信息披露费、银行间账户维护费等固定费用。

§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	15,519,826.42	30.99
	其中：股票	15,519,826.42	30.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	24,400,713.55	48.72
	其中：债券	24,400,713.55	48.72
	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	4,398,045.94	8.78
	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	5,549,605.98	11.08
8	其他各项资产	216,580.99	0.43
9	合计	50,084,772.88	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 137,973.87 元，净值占比 0.28%。

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	587,520.00	1.18
B	采矿业	807,204.00	1.62
C	制造业	9,899,945.55	19.86
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	1,958,696.00	3.93
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	497,280.00	1.00
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	1,272,475.00	2.55
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	358,732.00	0.72
S	综合	-	-
	合计	15,381,852.55	30.85

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
日常消费品	137,973.87	0.28
合计	137,973.87	0.28

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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	301015	百洋医药	56,000	1,675,520.00	3.36
2	300151	昌红科技	89,200	1,605,600.00	3.22
3	300662	科锐国际	57,500	1,272,475.00	2.55
4	688037	芯源微	10,696	886,163.60	1.78
5	603027	千禾味业	63,200	885,432.00	1.78
6	603505	金石资源	27,400	807,204.00	1.62
7	002371	北方华创	2,200	805,156.00	1.62
8	688089	嘉必优	35,335	716,947.15	1.44
9	002568	百润股份	26,000	599,300.00	1.20
10	600779	水井坊	12,900	592,497.00	1.19

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	10,417,119.45	20.90
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,068,297.27	2.14
	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）	12,915,296.83	25.91
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,400,713.55	48.94

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	019735	24 国债 04	40,000	4,065,128.77	8.15
2	110059	浦发转债	30,000	3,324,318.90	6.67
3	019547	16 国债 19	20,000	2,313,967.12	4.64
4	019752	24 特国 05	20,000	1,993,400.55	4.00
5	2028051	20 浦发银行永续债	10,000	1,068,297.27	2.14

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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

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，上海浦东发展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波监管局、国家外汇管理局湖州市分局、中国人民银行浙江省分行、中国银保监会无锡监管分局的处罚。重庆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重庆监管局和陕西监管局的处罚。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	14,394.16
2	应收证券清算款	202,186.83

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	216,580.99

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	3,324,318.90	6.67
2	113056	重银转债	1,055,073.56	2.12
3	123109	昌红转债	878,408.57	1.76
4	123194	百洋转债	663,739.95	1.33
5	113037	紫银转债	507,068.19	1.02
6	128106	华统转债	488,686.16	0.98
7	127018	本钢转债	486,844.58	0.98
8	123223	九典转 02	434,081.12	0.87
9	110055	伊力转债	422,906.55	0.85
10	123188	水羊转债	346,100.86	0.69
11	113060	浙 22 转债	324,705.35	0.65
12	113621	彤程转债	303,382.29	0.61
13	127069	小熊转债	293,096.88	0.59
14	123025	精测转债	271,028.90	0.54
15	113648	巨星转债	251,524.53	0.50
16	110068	龙净转债	247,412.90	0.50
17	123186	志特转债	244,990.37	0.49
18	113632	鹤 21 转债	192,775.12	0.39
19	113584	家悦转债	179,825.35	0.36
20	118021	新致转债	158,702.66	0.32
21	123222	博俊转债	156,766.58	0.31
22	123182	广联转债	149,264.62	0.30
23	127092	运机转债	148,328.88	0.30
24	123176	精测转 2	147,404.49	0.30
25	128142	新乳转债	147,382.70	0.30
26	118028	会通转债	146,181.97	0.29
27	110093	神马转债	145,496.87	0.29
28	123179	立高转债	144,843.35	0.29
29	123113	仙乐转债	141,118.21	0.28
30	111003	聚合转债	140,953.79	0.28
31	127085	韵达转债	139,295.72	0.28
32	123133	佩蒂转债	94,752.23	0.19
33	111000	起帆转债	92,789.92	0.19
34	113542	好客转债	45,048.11	0.09

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 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时荣升稳健添利混合A	博时荣升稳健添利混合C
本报告期期初基金份额总额	42,407,279.59	1,611,845.25
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	-	-
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	42,407,279.59	1,611,845.25

§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 2024 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理 380 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 15835 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 6105 亿元人民币，累计

分红逾 2044 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荣升稳健添利 18 个月定期开放混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时荣升稳健添利 18 个月定期开放混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时荣升稳健添利 18 个月定期开放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、博时荣升稳健添利 18 个月定期开放混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时荣升稳健添利 18 个月定期开放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、基金托管人住所

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
二〇二四年十月二十五日