

# 博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金

2022年第1季度报告

2022年03月31日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2022年04月22日

## 目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要财务指标	4
3.2 基金净值表现	5
§4 管理人报告	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 公平交易专项说明	8
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	9
4.5 报告期内基金的业绩表现	11
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	11
§5 投资组合报告	11
5.1 报告期末基金资产组合情况	11
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	11
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	13
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	13
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	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	14
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	14
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	14
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	14
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	14
5.11 投资组合报告附注	15
§6 开放式基金份额变动	17
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	17
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	17
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	17
§8 影响投资者决策的其他重要信息	18
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	18
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	18
§9 备查文件目录	18
9.1 备查文件目录	18
9.2 存放地点	18
9.3 查阅方式	18

## § 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年4月20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2022年01月01日起至2022年03月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	博道盛利6个月持有期混合
基金主代码	010404
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年12月24日
报告期末基金份额总额	132,351,804.06份
投资目标	在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置和投资管理，追求超越基金业绩比较基准的长期资本增值。
投资策略	在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，确定并动态调整大类资产的投资比例。本基金债券投资通过对宏观经济、货币和财政政策的分析，利率走势和收益率曲线变化的判断，不同类别债券品种的利差和变化趋势以及个券流动性、到期收益率、信用等级、税收等因素的分析构建债券组合，主要包括久期管理策略、期限结构配置策略、类属配置策略、个券选择、可转债投资、信用债投资等积极的投资策略。本基金的股票投资策略是坚持行业配置策略与个股精选策略相结合的投资理念，采用自下而上的积极选股策略，对行业和个股投资价值进

	行评估，选择具备长期竞争优势和投资潜力的细分行业和个股进行投资，港股通投资重点关注A股稀缺性行业和个股、具有持续领先优势或核心竞争力的与A股同类公司相比具有估值优势的公司。本基金的资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*75%+中证800指数收益率*20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
基金管理人	博道基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

注：本基金对认/申购、转换转入的每份基金份额设定6个月的最短持有期限，基金份额在最短持有期限内不办理赎回及转换转出业务，最短持有期限为持有期起始日（含）至持有期到期日（不含），自持有期到期日（含该日）起可以提出赎回或转换转出申请。

### § 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（2022年01月01日 - 2022年03月31日）
1. 本期已实现收益	-12,777,863.26
2. 本期利润	-9,483,932.13
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0685
4. 期末基金资产净值	129,187,376.50
5. 期末基金份额净值	0.9761

注：1、上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，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变

动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

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	-6.48%	0.47%	-3.38%	0.39%	-3.10%	0.08%
过去六个月	-3.72%	0.42%	-2.85%	0.30%	-0.87%	0.12%
过去一年	-2.71%	0.42%	-2.44%	0.27%	-0.27%	0.15%
自基金合同生效起至今	-2.39%	0.43%	-1.52%	0.29%	-0.87%	0.14%

#### 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

博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年12月24日-2022年03月31日)



注：本基金基金合同生效日为2020年12月24日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

## § 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		
张建胜	博道盛利6个月持有期混合（自2020年12月24日至2022年2月9日）、博道盛彦混合、博道盛兴一年持有期混合的基金经理	2020-12-24	2022-02-09	12年	张建胜先生，中国籍，MBA。2007年8月至2010年8月担任安永（中国）企业咨询有限公司分析师，2010年8月至2014年12月担任申银万国证券研究所有限公司分析师，2015年1月至2017年7月担任上海博道投资管理有限公司高

					<p>级分析师、股票投资经理。2017年8月加入博道基金管理有限公司，历任专户投资一部投资经理。具有基金从业资格。自2020年12月24日至2022年2月9日担任博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金基金经理、自2021年6月1日起担任博道盛彦混合型证券投资基金基金经理至今、自2022年3月8日起担任博道盛兴一年持有期混合型证券投资基金基金经理至今。</p>
高凯	博道盛利6个月持有期混合的基金经理	2020-12-24	2022-02-09	10年	<p>高凯女士，中国籍，经济学硕士。2012年4月至2015年2月担任中银基金管理有限公司债券高级研究员，2015年2月至2015年7月担任九泰基金管理有限公司固定收益部投资经理助理，2015年8月至2016年4月担任中国人寿养老保险股份有限公司固定收益部投资经理助理，2016年5月至2018年9月担任创金合信基金管理有限公司固定收益部投资经理，2018年10月加入博道基金管理有限公司，历任专户投资二部投资经理。具有基金从业资格。自2020年12月24日至2022年2月9日担任博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金基金经理。现任专户投资二部</p>

					投资经理。
陈连权	博道盛利6个月持有期混合的基金经理、固定收益投资总监	2022-02-09	-	15年	陈连权先生, 经济学硕士, 15年证券、基金从业经验。2007年8月至2015年5月任交银施罗德基金管理有限公司投资研究部分析师、专户投资部副总经理。2015年5月至2017年11月任富国基金管理有限公司固定收益研究部总经理、固定收益专户投资部总经理、固定收益投资总监兼基金经理。2018年2月至2021年12月任上海远海资产管理有限公司副总经理、投资总监、研究总监。2021年12月加入博道基金管理有限公司, 现任固定收益投资总监。自2022年2月9日起担任博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金基金经理至今。

#### 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》、基金合同和其他相关法律法规的规定, 并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定, 为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平, 旗下所管理的所有资产组合, 包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台, 确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度, 建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易, 遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则, 实现投资组合间公平交易分配; 对于非集中竞价交易、以公司名义进行的

场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司交易部和监察稽核部进行日常投资交易行为监控，监察稽核部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现违反公平交易的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，本公司管理的所有投资组合参与交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况共发生6次，经检查未发现异常；本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022年一季度，在外部地缘政治冲突、美联储加息，内部经济寻底、疫情反复的背景下，市场预期多次反复，风险偏好有较大程度下降。全季看，股票方面，沪深300下跌14.53%、中证500下跌14.06%，国证2000下跌11.82%，基金重仓指数下跌17.79%，小市值有所占优，机构股受重挫；债券方面，美债十年上行80BP，中债十年上行1BP，中美两国货币政策与利率延续背离；商品方面，南华工业品指数上涨24.58%，受俄乌冲突刺激，成为一季度表现最好的大类资产。

对于上述市场表现，一种归因是，全球可能进入“大滞胀”，看上去很好地解释了商品飙升下的股债双杀，然而，我们想更多地探究细节，当“这一次不一样”的声音再次来临，细察秋毫之末，或许有助于更好地看清未来。

其一、股债双杀有几种情景？股债双杀在历史上并不罕见，其原因大多与流动性紧张相关，可能是广义紧张（比如，2011年因通胀收紧货币，2013年外部Taper内部钱荒），也可能是狭义紧张（比如基金赎回、止损等微观行为）。有观点认为，一季度股债齐跌的根本原因是俄乌冲突及其全球脱钩下的“大滞胀”，以及对中国资产的提前猎杀，这一长逻辑在本质上属于上述的广义紧张，然而，一方面，美债在3月份的加息预期及实际加息幅度在事实上是下降的，美股亦未与A股一样剧烈反应，而我国央行亦未因此政策逆转；另一方面，长逻辑影响较长，资产价格往往“阴跌”，而短逻辑夹带情绪较重，常常“急跌”，因此，下跌也可能是微观上的情绪集中释放，即狭义紧张。

其二、避险工具有几种？在对股票的避险对冲中，典型工具有两种：债券及商品CTA，都源于与股票的负相关特征，然而，此两者的逻辑本源并不相同，股债负相关来源于经济周期及广义避险，CTA与股票负相关则来源于事件冲击下的波动率飙升。当波动率突

然上升，往往意味着市场的反向趋势（可能上涨也可能下跌）已经形成，CTA因此受益，股票则往往受损。一季度CTA上涨是在商品本已处上升通道上的突然加速，短期波动率急速上穿长期波动率，这与2020年疫情之初恰好相反，彼时也是短波急速上穿长波，但CTA是通过商品下跌而获利，并且股跌债涨，三者一起对浓厚的经济衰退及广义避险作出反应。而若比较当前，显然存在较大区别，当前事件冲击的成色更重，进一步，若观察商品波动率结构（从来是强烈均值回复），短波在当前处于40%左右高位，长波在（下降中的）30%附近，意味着波动率在未来可能会被压缩，事件影响也可能随之消退。

其三、总量流动性变化了吗？相比于其它市场，债市更能反应流动性，如前所述，股债齐跌可能并非来自总量收紧，除了中央银行没有收紧的实质动作或信号，也可从债市的微观结构中得到印证。在长端利率上行时，伴随存单利率上升，票据利率下降，票据利率下降与2月份金融数据低于预期一致，反应了货币放松初期的数据反复及偏短且偏弱的信贷结构，此种情况在2016年与2019年都曾发生，也反映了货币总供给的宽松，然而，存单利率却是上升的，可能与大小银行的资产负债供需错配有关，而如果注意到债基偏好的短久期债券品种一样同步利率上行，那么，也可能是反应了广义基金的抛售行为。

其四、众多风险在广义资产上分布如何？简要概括市场所忧，大体有：A、地缘政治；B、动荡环境中的新兴市场风险；C、美联储加息风险；D、国内疫情反复拖累经济；E、北向及外资流出风险；F、量化及绝对收益型基金止损冲击。对于上述风险，各有一些市场或资产与之关系密切，比如，欧洲股市受地缘政治影响应该更大，越南、中国台湾、中国香港市场同样具有新兴市场风险，纳斯达克与新兴市场同样受美联储加息影响，陆（沪）股通指数与上证50可能与外资流动更相关，中证500与国证2000可能与量化类更相关，其成分股中的中小企业可能受疫情经济的拖累更大。逻辑上讲，风险越大，相关性越大，指数表现越差。然而，如果观察上述指数表现，基金重仓指数表现垫底，似乎承载了所有风险，而本应与风险更相关的其他指数却得以跑赢，风险分布显著不均匀，或许也表明中国市场似乎忧虑过多。进一步，若观察A股的因子表现，在我们跟踪的大类因子中，与投资者行为相关的因子（非流动性、换手率、资金流等）大多回撤，而与基本面相关的因子（成长、价值、盈利等）则表现分化，机构重配的成长与盈利因子回撤，机构低配的传统价值因子跑赢，或许表明，在2021年底开启的风格切换持续的同时，市场遭遇了广义基金的股票抛售。

展望未来，情绪总有摇摆，理性也必将回归，尽管2022年3月部分城市的疫情反复确实增加了一定的不确定，比如，3月PMI回落至49.5，但是，如果从中期角度看，信贷脉冲上行，经济上摆，仍然属于大概率事件，更重要的是，假如未来与宏观只能属于不确定，投资者更应该将视角聚焦于确定性的价值寻找。于股票而言，当前风险溢价处于2015年以来的次高水平，也已高于经济基本面所隐含的中枢水平，在此区域，过度悲观可能已是对未来的一种浪费；于债券而言，疫情给经济的边际承压一定程度提升了中央银行进一步宽松的概率，但在疫后经济回升以及在内外政策平衡的制约下，仍然存在上升可能，而在地产所压制的中性利率下行的背景下，其顶部也仍然可见，因而，我们仍然没有改变对利率可能折返跑的判断。

本基金管理人将继续坚持攻守兼备的投资思路，积极跟踪把握基本面与市场的变化，保持对市场的尊重及敬畏，秉持勤勉尽责，力争为投资者获得有竞争力的投资收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金份额净值及业绩表现请见“3.1 主要财务指标”及“3.2.1 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”部分披露。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

### § 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	44,092,179.25	33.96
	其中：股票	44,092,179.25	33.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	74,960,687.45	57.74
	其中：债券	74,960,687.45	57.74
	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	10,779,246.65	8.30
8	其他资产	129.87	0.00
9	合计	129,832,243.22	100.00

注：1、银行存款和结算备付金合计余额包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金；

2、本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值及占基金资产净值比例请见“5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合”部分披露。

#### 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	261,906.00	0.20
B	采矿业	2,007,560.00	1.55
C	制造业	22,085,597.34	17.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,358,056.00	1.05
E	建筑业	1,327,262.00	1.03
F	批发和零售业	4,188,152.00	3.24
G	交通运输、仓储和邮政业	1,427,708.00	1.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,442,714.00	2.66
J	金融业	1,495,751.00	1.16
K	房地产业	3,500,975.00	2.71
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	130,748.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	324,750.00	0.25
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	433,944.00	0.34
S	综合	-	-
	合计	41,985,123.34	32.50

## 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(%)
能源	263,983.76	0.20
原材料	156,938.55	0.12
工业	294,883.24	0.23
可选消费	293,751.07	0.23
主要消费	80,338.65	0.06

医药卫生	336,698.92	0.26
金融	595,386.77	0.46
公用事业	85,074.95	0.07
合计	2,107,055.91	1.63

注：以上分类采用中证CICS一级分类标准编制。

### 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	002726	龙大美食	132,800	1,269,568.00	0.98
2	600503	华丽家族	278,000	931,300.00	0.72
3	601028	玉龙股份	38,000	771,400.00	0.60
4	603489	八方股份	4,400	767,844.00	0.59
5	000652	泰达股份	170,400	759,984.00	0.59
6	600335	国机汽车	89,600	758,016.00	0.59
7	002807	江阴银行	149,400	642,420.00	0.50
8	600649	城投控股	135,100	640,374.00	0.50
9	601001	晋控煤业	39,100	615,434.00	0.48
10	600606	绿地控股	100,400	541,156.00	0.42

### 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	35,098,221.79	27.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,167,008.22	15.61
	其中：政策性金融债	20,167,008.22	15.61
4	企业债券	10,316,258.08	7.99
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	9,379,199.36	7.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	74,960,687.45	58.02

**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	019547	16国债19	209,340	20,636,828.97	15.97
2	019641	20国债11	142,000	14,461,392.82	11.19
3	143216	17京资02	100,000	10,316,258.08	7.99
4	210211	21国开11	100,000	10,138,186.30	7.85
5	220205	22国开05	100,000	10,028,821.92	7.76

**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**

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**

在法律法规允许的范围内，本基金根据风险管理原则，以套期保值为目的，投资于国债期货合约，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，并充分考虑国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等因素，通过多头或空头套期保值等策略进行操作。

**5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
国债期货投资本期收益(元)					249,805.82

国债期货投资本期公允价值变动（元）	-175,500.00
-------------------	-------------

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金参与国债期货的投资交易，符合法律法规规定和基金合同的投资限制，并遵守相关的业务规则，且对基金的总体风险相对中性。

### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或者在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(1) 截至本报告期末，兴业转债（证券代码113052）为本基金持有的前十大证券。2021年7月7日，中国银保监会消费者权益保护局发布《关于兴业银行侵害消费者权益情况的通报》（银保监消保发〔2021〕12号），指出兴业转债的发行主体兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）存在默认勾选信用卡自动分期起始金额、适当性管理落实不到位、向个人住房按揭贷款客户搭售人身意外险以及代销保险业务中欺骗投保人、隐瞒与保险合同有关的重要情况等6类违法违规问题。2021年8月5日，兴业银行因违规办理内保外贷业务、未按规定报送财务会计报告和统计报表等资料、违反外汇市场交易管理规定、未按规定保存交易通讯记录、违规办理银行卡业务，收到国家外汇管理局福建省分局责令改正、给予警告、没收违法所得和罚款合计300万元、责令对相关责任人进行处分的行政处罚（闽汇罚〔2021〕5号）。2021年8月20日，兴业银行因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，收到中国人民银行罚款5万元的行政处罚（银罚字〔2021〕26号）。2022年3月21日，兴业银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在十四项违法违规行为，收到中国银保监会罚款350万元的行政处罚（银保监罚决字〔2022〕22号）。

截至本报告期末，浦发转债（证券代码110059）为本基金持有的前十大证券。2021年4月23日，发行主体上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”）因2016年5月至2019年1月未按规定开展代销业务，收到中国银保监会上海监管局罚款760万元的行政处罚（沪银保监罚决字〔2021〕29号）。2021年7月13日，浦发银行因监管发现的问题屡查屡犯、配合现场检查不力、内部控制制度修订不及时等三十一项违法违规事实，收到中国银保监会罚款6920万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕27号）。2022年3月21日，浦发银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在十六项违法违规行为，收到中国银保监会罚款420万元的行政处罚（银保监罚决字〔2022〕25号）。

截至本报告期末，上银转债（证券代码113042）为本基金持有的前十大证券。2021年4月25日，发行主体上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”），因未按照规定进行信息披露，收到中国银保监会上海监管局责令改正、罚款30万元的行政处罚（沪银保监罚决字〔2021〕31号）。2021年7月2日，上海银行因2020年6月至12月部分业务以贷收费等六项违法违规事实，收到中国银保监会上海监管局责令改正、罚款共计460

万元的行政处罚（沪银保监罚决字（2021）72号）。2021年11月19日，上海银行因未按规定报送统计报表，收到中国银保监会上海监管局罚款20万元的行政处罚（沪银保监罚决字（2021）174号）。2022年2月14日，上海银行因2015年3月至7月同业投资业务违规接受第三方金融机构担保，收到中国银保监会上海监管局责令改正、罚款240万元的行政处罚（沪银保监罚决字（2022）13号）。

本基金认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。

（2）报告期内本基金投资的前十名证券中，其他证券发行主体无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 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的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	129.87
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	129.87

### 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	1,397,476.56	1.08
2	113042	上银转债	1,391,023.24	1.08
3	110053	苏银转债	798,934.88	0.62
4	127018	本钢转债	759,026.04	0.59
5	113013	国君转债	738,522.28	0.57
6	127032	苏行转债	737,650.18	0.57
7	113021	中信转债	720,991.59	0.56
8	113044	大秦转债	717,211.15	0.56
9	128129	青农转债	693,343.20	0.54

### 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

报告期期初基金份额总额	149,340,391.50
报告期期间基金总申购份额	796,053.11
减：报告期期间基金总赎回份额	17,784,640.55
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	132,351,804.06

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

## § 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

报告期期初管理人持有的本基金份额	2,999,516.78
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	2,999,516.78
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	2.27

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则买入/申购总份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则卖出/赎回总份额中包含该业务；

3、分级基金“报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）”的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。非分级基金“报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）”的计算中，比例的分母采用期末基金份额总额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、转换、红利再投等。

## § 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

根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。自2022年1月1日起本基金已完成新金融工具准则的切换。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则未对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内博道盛利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

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 9.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站（www.bdfund.cn）查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博道基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-085-2888（免长途话费）。

博道基金管理有限公司

2022年04月22日