

---

博时季季享三个月持有期债券型证券投资  
基金

2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 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：二〇二四年一月二十二日

## §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 1 月 18 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 2023 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	博时季季享持有期		
基金主代码	000783		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2019 年 9 月 5 日		
报告期末基金份额总额	6,635,077,297.84 份		
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。		
投资策略	本基金为债券型基金。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相补充的方法，确定资产在固定收益类证券之间的配置比例。本基金灵活应用各种期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略等。本基金将投资组合的平均剩余期限控制在 2 年以内，在控制利率风险、在合理管理并控制组合风险的前提下，最大化组合收益。		
业绩比较基准	中债总财富（1-3 年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率(税后)×20%		
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。		
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	博时季季享持有期 A	博时季季享持有期 B	博时季季享持有期 C

下属分级基金的交易代码	000783	000784	007845
报告期末下属分级基金的份额总额	3,415,957,439.34 份	368,196,460.54 份	2,850,923,397.96 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 (2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日)		
	博时季季享持有期 A	博时季季享持有期 B	博时季季享持有期 C
1.本期已实现收益	21,297,925.52	2,004,794.59	14,940,692.41
2.本期利润	25,928,065.26	2,491,575.51	18,744,314.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0074	0.0065	0.0064
4.期末基金资产净值	3,823,063,532.04	407,632,889.57	3,158,279,078.61
5.期末基金份额净值	1.1192	1.1071	1.1078

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. 博时季季享持有期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	0.67%	0.02%	0.71%	0.03%	-0.04%	-0.01%
过去六个月	1.15%	0.02%	1.11%	0.03%	0.04%	-0.01%
过去一年	3.19%	0.02%	2.60%	0.02%	0.59%	0.00%
过去三年	8.78%	0.02%	8.59%	0.03%	0.19%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	14.72%	0.03%	12.37%	0.04%	2.35%	-0.01%

###### 2. 博时季季享持有期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	0.60%	0.02%	0.71%	0.03%	-0.11%	-0.01%
过去六个月	0.99%	0.02%	1.11%	0.03%	-0.12%	-0.01%
过去一年	2.87%	0.02%	2.60%	0.02%	0.27%	0.00%

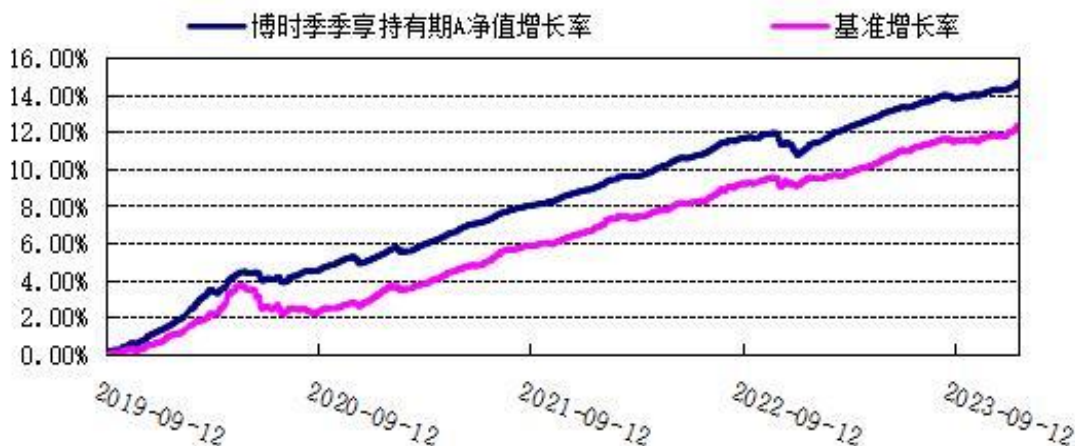
过去三年	7.80%	0.02%	8.59%	0.03%	-0.79%	-0.01%
自基金合同生效起至今	13.29%	0.03%	12.37%	0.04%	0.92%	-0.01%

**3. 博时季季享持有期C:**

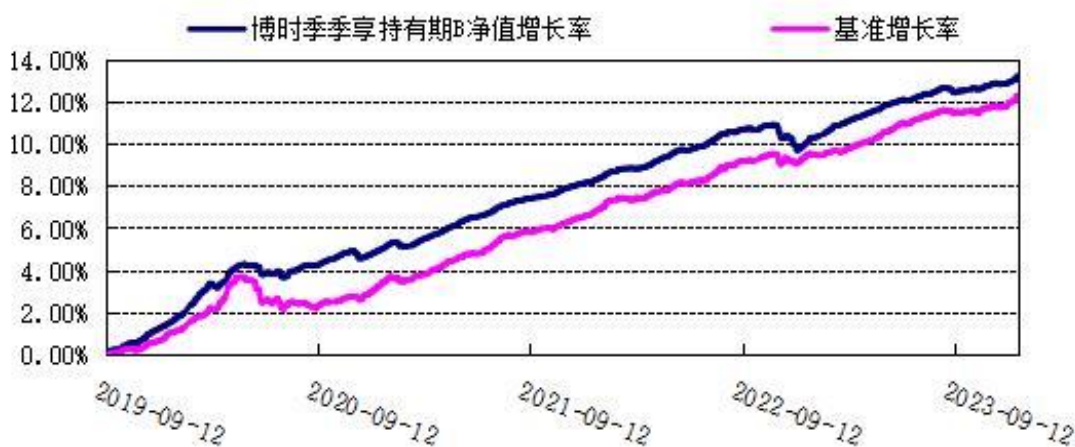
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.58%	0.02%	0.71%	0.03%	-0.13%	-0.01%
过去六个月	0.97%	0.02%	1.11%	0.03%	-0.14%	-0.01%
过去一年	2.88%	0.02%	2.60%	0.02%	0.28%	0.00%
过去三年	7.91%	0.02%	8.59%	0.03%	-0.68%	-0.01%
自基金合同生效起至今	13.31%	0.03%	12.37%	0.04%	0.94%	-0.01%

**3.2.2 自基金转型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**

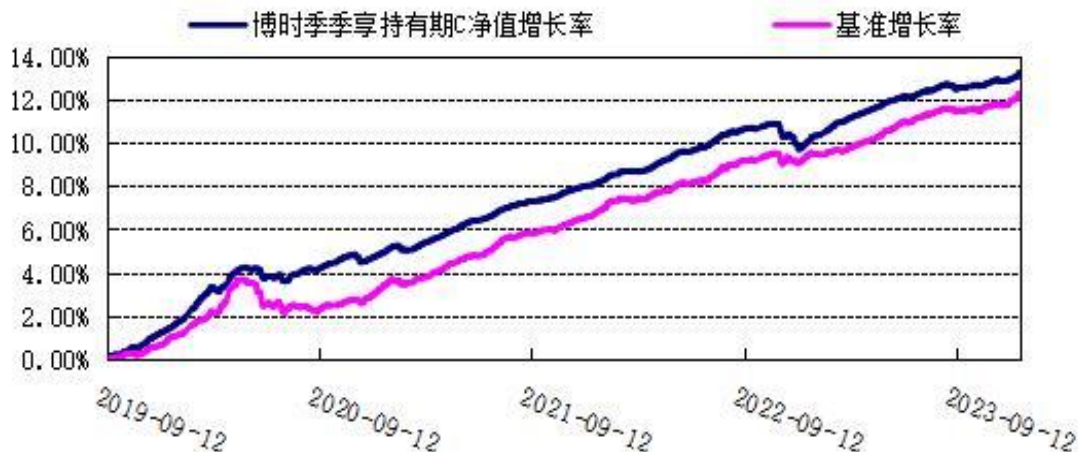
**1. 博时季季享持有期A:**



**2. 博时季季享持有期B:**



**3. 博时季季享持有期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		
于渤洋	基金经理	2022-01-24	-	5.7	于渤洋先生，硕士。2012年起先后在龙江银行股份有限公司、哈尔滨银行股份有限公司、生命保险资产管理有限公司工作。2019年加入博时基金管理有限公司。历任基金经理助理、博时华盈纯债债券型证券投资基金(2021年10月27日-2023年2月10日)、博时民丰纯债债券型证券投资基金(2021年10月27日-2023年5月31日)、博时安仁一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2021年10月27日-2023年7月26日)、博时裕安纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2021年10月27日-2023年7月26日)、博时裕盛纯债债券型证券投资基金(2021年10月27日-2023年7月26日)、博时富华纯债债券型证券投资基金(2021年10月27日-2023年7月26日)的基金经理。现任博时富乾纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基

				<p>金(2021年10月27日—至今)、博时广利纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2021年10月27日—至今)、博时聚盈纯债债券型证券投资基金(2021年10月27日—至今)、博时裕发纯债债券型证券投资基金(2021年10月27日—至今)、博时富益纯债债券型证券投资基金(2021年10月27日—至今)、博时季季享三个月持有期债券型证券投资基金(2022年1月24日—至今)、博时信用优选债券型证券投资基金(2022年5月5日—至今)、博时聚瑞纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2022年11月22日—至今)的基金经理,博时富恒纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、博时富汇纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理。</p>
<p>黄海峰</p>	<p>固定收益 投资一部 投资总监 助理/基金 经理</p>	<p>2019-09-05</p>	<p>-</p>	<p>13.6</p> <p>黄海峰先生, 学士。2004年起先后在深圳市农村商业银行、博时基金、银华基金、大成基金工作。2016年9月再次加入博时基金管理有限公司。历任博时裕通纯债债券型证券投资基金(2017年5月31日-2018年3月26日)、博时产业债纯债债券型证券投资基金(2017年5月31日-2018年5月30日)、博时盈海纯债债券型证券投资基金(2018年5月9日-2018年7月19日)、博时聚瑞纯债债券型证券投资基金(2017年11月8日-2018年9月3日)、博时富祥纯债债券型证券投资基金(2017年11月16日-2018年11月22日)、博时聚瑞纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018年9月3日-2018年11月22日)、博时裕安纯债债券型证券投资基金(2017年5月8日-2019年1月16日)、博时安荣18个月定期开放债券型证券投资基金(2017年6月15日-2019年3</p>

				<p>月 2 日)、博时富兴纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 4 月 12 日-2019 年 8 月 19 日)、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日-2019 年 9 月 5 日)、博时裕腾纯债债券型证券投资基金(2017 年 5 月 8 日-2020 年 7 月 7 日)、博时裕景纯债债券型证券投资基金(2017 年 5 月 8 日-2020 年 7 月 7 日)、博时裕乾纯债债券型证券投资基金(2017 年 5 月 31 日-2020 年 7 月 7 日)、博时裕鹏纯债债券型证券投资基金(2017 年 12 月 29 日-2020 年 7 月 7 日)、博时民丰纯债债券型证券投资基金(2017 年 12 月 29 日-2020 年 7 月 7 日)、博时富安纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 2 月 2 日-2020 年 7 月 7 日)、博时富乾纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 2 月 8 日-2020 年 7 月 7 日)、博时华盈纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日-2020 年 7 月 7 日)、博时广利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 5 月 28 日-2020 年 7 月 7 日)、博时富和纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日-2020 年 7 月 7 日)、博时裕新纯债债券型证券投资基金(2017 年 5 月 8 日-2020 年 7 月 20 日)、博时裕发纯债债券型证券投资基金(2017 年 5 月 8 日-2020 年 7 月 20 日)、博时富腾纯债债券型证券投资基金(2018 年 5 月 9 日-2020 年 7 月 20 日)、博时丰庆纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日-2020 年 7 月 20 日)、博时富丰纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2019 年 7 月 8 日-2020 年 7 月 20 日)、博时安仁一年定期开放债券型证券投资基金(2017 年 11 月 8 日-2020 年 9 月 8 日)、博时安心收</p>
--	--	--	--	---

				<p>益定期开放债券型证券投资基金(2016年12月28日-2021年3月31日)、博时聚利纯债债券型证券投资基金(2017年11月22日-2021年8月17日)、博时信用优选债券型证券投资基金(2020年5月22日-2021年8月17日)、博时富业纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2021年8月17日-2022年9月9日)、博时裕通纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018年3月26日-2023年2月1日)、博时裕乾纯债债券型证券投资基金(2021年10月27日-2023年2月1日)的基金经理。现任固定收益投资一部投资总监助理兼博时安盈债券型证券投资基金(2017年5月31日—至今)、博时聚源纯债债券型证券投资基金(2018年11月22日—至今)、博时季季享三个月持有期债券型证券投资基金(2019年9月5日—至今)、博时稳欣39个月定期开放债券型证券投资基金(2021年2月25日—至今)、博时富恒纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2021年11月25日—至今)、博时富璟纯债一年定期开放债券型证券投资基金(2021年12月2日—至今)、博时富尊纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2022年6月14日—至今)、博时安悦短债债券型证券投资基金(2022年12月27日—至今)、博时富安纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2023年4月3日—至今)、博时富鸿金融债3个月定期开放债券型证券投资基金(2023年9月1日—至今)的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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 45 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

2023 年四季度，债市主要受到资金面波动及政策面预期变化影响，利率整体呈倒“V”型走势。具体来看，10 月，特殊再融资债+国债接连发行，资金面持续偏紧。下旬 1 万亿增发国债政策出台，宽财政预期压制债市情绪，10 年国债收益率最高上行至 2.72%；11 月数据显示经济动能转弱，但资金面整体仍偏紧，地产政策放松带来情绪扰动，10 年国债整体在 2.65%-2.72% 区间震荡，短端受存单持续提价影响表现较弱，曲线趋平；12 月债券震荡走强，收益率月初高位震荡，月中开启下行，直至月末。月中中央经济工作会议政策基调未超预期，加之通胀数据、金融数据表现偏弱，债市收益率开启震荡下行。下旬大行存款挂牌利率调降，市场降息预期升温，叠加年末机构抢跑行为，收益率迎来快速下行。短端收益率受资金面预期变化影响下行幅度更大，曲线陡峭化。月末 10 年国债收益率下行至 2.555%，较三季度末回落 12bp。信用债方面，受无风险利率波动及化债行情演绎两方面影响，信用利差先压缩后走扩。中低等级中长期限表现更优。

展望后市，预计一季度债市整体震荡。国内方面，中央经济工作会议仍强调高质量发展，坚持稳中求进，以进促稳，先立后破。12 月制造业 PMI 连续第三个月回落，M1 同比创年内新低，显示需求不足依然明显，信用扩张不畅，经济仍处于磨底状态，基本面拐点未至。海外方面，美联储议息会议意外转鸽，首次讨论降息，人民币明显升值，央行外部约束放松。债市所处宏观环境仍较友好。货币政策强调逆周期和跨周期调节，信贷投放更加注重平滑波动和用好存量，整体流动性环境预计较四季度有所改善，但年末债

市收益率已对资金面改善预期提前反应。此外，万亿增发国债陆续使用及信贷开门红将对一季度经济产生拉动作用。综合来看，一季度市场或表现震荡，短端资产的票息价值确定性更高。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1192 元，份额累计净值为 1.1447 元，本基金 B 类基金份额净值为 1.1071 元，份额累计净值为 1.1308 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.1078 元，份额累计净值为 1.1311 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.67%，本基金 B 类基金份额净值增长率为 0.60%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 0.58%，同期业绩基准增长率为 0.71%。

#### 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	-	-
3	固定收益投资	8,480,332,665.27	94.70
	其中：债券	8,480,332,665.27	94.70
	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	464,492,665.47	5.19
8	其他资产	10,054,711.00	0.11
9	合计	8,954,880,041.74	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	364,685,253.56	4.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,242,882,209.94	16.82
	其中：政策性金融债	505,563,458.61	6.84
4	企业债券	609,426,128.34	8.25
5	企业短期融资券	275,276,985.99	3.73
6	中期票据	5,592,603,947.68	75.69
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	395,458,139.76	5.35
9	其他	-	-
10	合计	8,480,332,665.27	114.77

### 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	210202	21 国开 02	1,700,000	175,002,843.84	2.37
2	101459002	14 营口港 MTN001	1,500,000	159,050,547.95	2.15
3	230023	23 付息国债 23	1,500,000	156,224,016.39	2.11
4	102101383	21 物产中大 MTN001	1,500,000	152,781,393.44	2.07
5	220322	22 进出 22	1,500,000	151,285,368.85	2.05

### 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，中国进出口银行在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会厦门监管局、大连监管局的处罚。国家开发银行在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会湖北监管局、国家金融监督管理总局山西监管局、国家金融监督管理总局浙江监管局的处罚。平安银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行、上海银保监局、大连银保监局、深圳市市场监督管理局、国家外汇管理局宁波市分局的处罚，受到中国银行间市场交易商协会的通报批评。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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,054,711.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,054,711.00

#### 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 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时季季享持有期A	博时季季享持有期B	博时季季享持有期C
本报告期期初基金份额总额	3,621,418,703.36	411,273,653.82	3,088,519,782.00
报告期期间基金总申购份额	139,787,013.29	17,666,308.51	109,582,480.38
减：报告期期间基金总赎回份额	345,248,277.31	60,743,501.79	347,178,864.42
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	3,415,957,439.34	368,196,460.54	2,850,923,397.96

## §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 2023 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 367 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 14668 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 5478 亿元人民币，累计分红逾 1936 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季季享三个月持有期债券型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时季季享三个月持有期债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时季季享三个月持有期债券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、博时季季享三个月持有期债券型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时季季享三个月持有期债券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  
二〇二四年一月二十二日