

博时恒耀债券型证券投资基金
2024 年第 1 季度报告
2024 年 3 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年四月二十二日

§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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 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 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时恒耀债券
基金主代码	016670
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 11 月 10 日
报告期末基金份额总额	147,995,417.05 份
投资目标	本基金在控制风险的前提下，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	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，在股票、债券、基金和现金等资产类别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。本基金采用的债券等固定收益类资产投资策略包括：期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、可转换债券及可交换债券投资策略等。本基金的投资策略还包括股票投资策略、基金投资策略、国债期货投资策略、流通受限证券投资策略、购买信用衍生品规避个券信用风险策略。
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×5%+中证港股通综合指数（CNY）收益率×5%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。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	平安银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	博时恒耀债券 A	博时恒耀债券 C
下属分级基金的交易代码	016670	016671
报告期末下属分级基金的份额总额	126,399,119.52 份	21,596,297.53 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 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日)	
	博时恒耀债券 A	博时恒耀债券 C
1.本期已实现收益	-610,882.51	-110,258.31
2.本期利润	735,009.63	84,939.36
3.加权平均基金份额本期利润	0.0056	0.0038
4.期末基金资产净值	121,364,325.17	20,635,929.43
5.期末基金份额净值	0.9602	0.9555

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. 博时恒耀债券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	0.74%	0.47%	1.81%	0.11%	-1.07%	0.36%
过去六个月	0.06%	0.39%	2.32%	0.10%	-2.26%	0.29%
过去一年	-4.31%	0.33%	3.61%	0.10%	-7.92%	0.23%
自基金合同 生效起至今	-3.98%	0.30%	5.34%	0.10%	-9.32%	0.20%

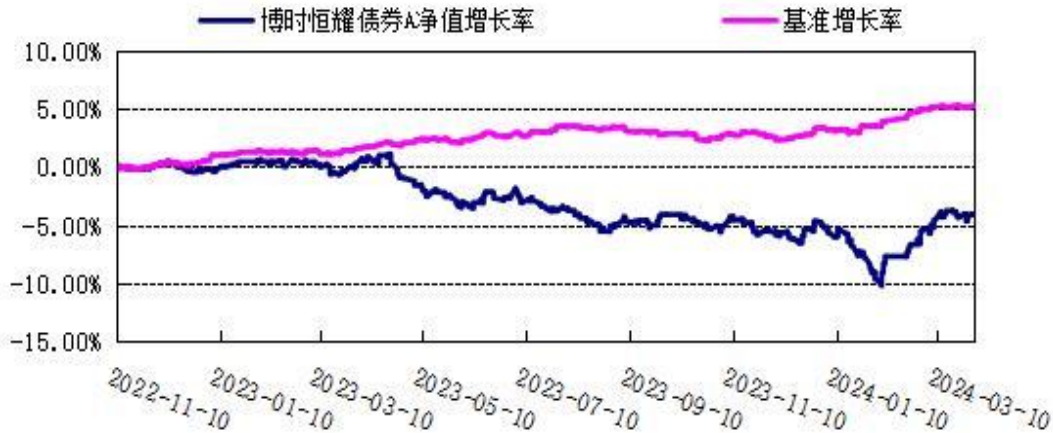
2. 博时恒耀债券C:

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	0.65%	0.47%	1.81%	0.11%	-1.16%	0.36%
过去六个月	-0.13%	0.39%	2.32%	0.10%	-2.45%	0.29%

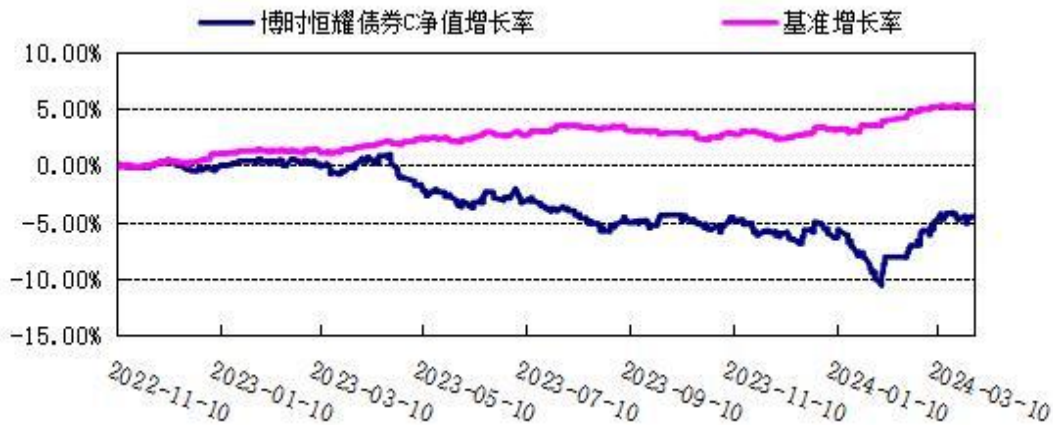
过去一年	-4.65%	0.34%	3.61%	0.10%	-8.26%	0.24%
自基金合同生效起至今	-4.45%	0.30%	5.34%	0.10%	-9.79%	0.20%

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. 博时恒耀债券A:



2. 博时恒耀债券C:



注：本基金的基金合同于 2022 年 11 月 10 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		
过钧	首席基金经理/基金经	2022-11-10	-	22.7	过钧先生，硕士。1995 年起先后在上海工艺品进出口公司、德国德累斯顿银行

	理			<p>上海分行、美国 Lowes 食品有限公司、美国通用电气公司、华夏基金固定收益部工作。2005 年加入博时基金管理有限公司。历任博时稳定价值债券投资基金(2005 年 8 月 24 日-2010 年 8 月 4 日)基金经理、固定收益部副总经理、博时转债增强债券型证券投资基金(2010 年 11 月 24 日-2013 年 9 月 25 日)、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金(2013 年 2 月 1 日-2014 年 4 月 2 日)、博时裕祥分级债券型证券投资基金(2014 年 1 月 8 日-2014 年 6 月 10 日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2013 年 9 月 13 日-2015 年 7 月 16 日)、博时新财富混合型证券投资基金(2015 年 6 月 24 日-2016 年 7 月 4 日)、博时新机遇混合型证券投资基金(2016 年 3 月 29 日-2018 年 2 月 6 日)、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 8 月 1 日-2018 年 2 月 6 日)、博时稳健回报债券型证券投资基金 (LOF)(2014 年 6 月 10 日-2018 年 4 月 23 日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2016 年 10 月 24 日-2018 年 5 月 5 日)、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 2 月 10 日-2018 年 5 月 21 日)、博时鑫和灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 12 月 13 日-2018 年 6 月 16 日)、博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 1 月 10 日-2018 年 7 月 30 日)的基金经理、固定收益总部公募基金组负责人、博时新价值灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 3 月 29 日-2019 年 4 月 30 日)、博时乐臻定期开放混合型证券投资基金(2016 年 9 月 29 日-2019 年 10 月 14 日)、博时转债增强债券型证券投资基金(2019 年 1 月 28 日-2020 年 4 月 3 日)、博时鑫源灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 9 月 6 日-2020 年 7 月 20 日)、博时新起点灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 10 月 17 日-2020 年 7 月 20 日)、博时鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 2 月 10 日-2020 年 7 月 20 日)、博时中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金(2019 年 7 月 19 日-2020 年</p>
--	---	--	--	---

				10 月 26 日)的基金经理、固定收益总部指数与创新组负责人、公司董事总经理、博时中债 3-5 年进出口行债券指数证券投资基金(2018 年 12 月 25 日-2021 年 8 月 17 日)基金经理。现任首席基金经理兼博时信用债券投资基金(2009 年 6 月 10 日—至今)、博时新收益灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 2 月 29 日—至今)、博时双季鑫 6 个月持有期混合型证券投资基金(2021 年 1 月 20 日—至今)、博时浦惠一年持有期混合型证券投资基金(2022 年 2 月 17 日—至今)、博时恒耀债券型证券投资基金(2022 年 11 月 10 日—至今)、博时信享一年持有期混合型证券投资基金(2023 年 3 月 8 日—至今)、博时中证可转债及可交换债券交易开放式指数证券投资基金(2023 年 9 月 15 日—至今)、博时转债增强债券型证券投资基金(2023 年 9 月 15 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遵规守信情况的说明

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 59 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

1Q 美联储两次会议继续维持目标利率 5.25-5.5% 不变，但在 3 月份会议上提高了明后年的政策利率预期，反映美国经济的韧性和通胀预期的抬升。美国核心 CPI 已经从两年前 5.6% 回调到当前的 2.8%，似乎距离 2% 目标已不远，但还能进一步下降吗？上季度季报我们认为：美联储过早停止加息可能会有二次通胀的风险。但主因在于不加节制的财政“衰退式花钱”。美国债务已达 34 万亿美元，仅过去 12 个月 1.1 万亿美元的利息支出使得联储有极大的动力控制利息成本，当前 4% 左右的长债收益率反映了市场对美国未来通胀的担忧。但这个场景下美国经济可能软着陆，不太可能进入衰退，由此带来上升的中长期利率、陡峭的收益率曲线、美元的贬值以及大宗商品的狂欢。世界主要经济体在今年集体的货币政策转向可能成为一个小幅降息周期的开端，急于结束之前激进的加息周期成为各国共识。当然，对中国的出口和汇率而言，则是一个好消息。而从大宗商品角度来看，与美元美债走势有脱钩迹象，可能也是“美元废纸化”的开端。

地产的持续低迷和经济转型大背景下，市场对经济的悲观情绪依旧挥之不去，本季度收益率曲线继续整体下移。期间央行降准 50bps 和调降 5 年期 LPR 利率，使得短端利率下行大于中长期，而 1 年以上品种曲线平行下移，长期限品种表现更佳，总体收益率曲线呈现牛陡行情，而 30/10 年利差创历史新低。与风险偏好和流动性比较，交易属性似乎更能解释超长期债券收益率的下行。当资本利得成为市场追逐的热点和主要收益来源之际，可能也是风险积聚之时。在美联储正式启动降息之前，中国央行降息的可能性似乎不高，而美联储今年降息时点很可能推迟到下半年。“短期看海外，长期看地产”。目前地产部门依然对长端利率影响最大：地产部门决定利率中枢，而非地产部门则决定了利率波动的节奏。考虑到财政扩张动力、财富效应改善和出口韧性，今年 5% 的经济目标有望实现。1 季度超预期的经济数据是不是能改变债市的观点，还要拭目以待。本季度我们继续维持短期利率债品种配置。

伴随市场利率全线下行，信用利差也随之收窄。低利率环境下资产荒加剧，从而加大信用债配置压力。与利率债中长期表现好于短端类似，信用债低等级品种表现强于中高等级，这与以前的信用债牛市表现相反。信用债等级利差也到了历史新低，信用利差重新回到疫情高峰时低点，而期限利差同样创下历史新低。由于去年化债点燃投资者的热情，信用债系统性风险下降极大助推了各利差到达历史低点，也造成了资产荒现象。当前信用债短端价值尚可，长端博弈价值加大，低等级品种谨慎参与。随着 20 年城投债投出 3% 的票面，我们认为市场已经达到一个极致的水平。如市场出现逆转，利率债收益率回升或将带来信用利差走阔和流动性缺失。本季度我们依旧低配信用债。

本季度转债市场伴随权益市场先探底后反弹，但转债指数依旧录得负回报，只有偏债型转债期间回报为正。季初转债市场在股市大幅调整态势下延续去年 4Q 的跌势，最低时候重现历史：1) 转债纯债溢价率

接近历史极值和 2) 偏债型品种和纯信用债比价接近历史极值。股市经过连续 2 年熊市的调整，转债市场终于跌回到类似 18 年底的水平。但从转股溢价率而言，当前比 18 年底要高：显示当前因为期权价值的修复，转债优于纯债，但和正股相比，由于转股溢价率处于高位，性价比不如 18 年底。尽管 1 季度后期转债市场反弹，当前转债估值依旧处于较为便宜阶段，部分具有良好债底保护又有正股隐含看涨期权品种表现将好于纯债和偏债型品种。与高分红股票不同，高 YTM 转债并不一定意味着“优质资产”。转债的债券属性使得高 YTM 也可能意味着高风险的补偿，需要关注正股下跌和违约风险。本季度我们继续维持转债零配置。

本季度权益市场在经历剧烈波动后反弹企稳，季末主板市场年初以来回报已经回正。但从结构上看地产和消费弱于指数，投资者对未来增长预期依旧缺乏信心。从 1Q 市场情况来看，中国增长继续下行和美国经济软着陆是市场主要交易策略，大宗商品同样显示出内弱外强的特征。AI 是美国经济的希望，而地产依旧是拖累中国经济的主要风险点。具有债券特征的高分红股票继续表现亮眼。越来越多企业选择现金分红：当企业在行业内达到较高市占率，没有比自身 ROE 更高的投资方向时，是采取 1) 业务多元化扩张还是 2) 现金分红或回购注销来分配现金，是决定股票未来的回报的重要因素。原来上市公司多选择前者，而在在管理层的鼓励下，后者越来越普遍，这是一个正确的方向，也是对投资者有利的方向。红利股票不仅仅看当前较高的股息率，还要看盈利质量的稳定和增长。如企业进入下行周期，即使分红率不变，盈利的下滑也可能引发派息下降，需要避开高股息陷阱。债市走强也有助红利股票的表现，但如果经济从底部走出，市场风格可能会切换。受益于全球定价、国内优势制造产业以及进口替代行业的公司可能有望跑赢市场。权益估值连续 3 年压缩这一极端事件可能在今年结束，CPI 的改善将是重要信号。本季度我们继续维持权益较高仓位，并调整了部分持仓。

综上所述，中国经济地产和非地产部门的分化，形成了截然不同的两个世界，股债投资者也分成了两个不同的阵营，各从不同的角度着眼，这种割裂也是历史仅见。归根到底就是房地产在中国经济中地位还重不重要的问题。让我们拉回到眼前，展望二季度，经济可能已经企稳，悲观预期可能在两会后得到扭转，去年同期增速突然下行的情形不太会重演，股债市场可能对预期都要重新进行修正。降息可能延后，利率债收益率可能已经见底，但上升幅度受制于房地产的修复程度；信用债由于利差处于历史地位吸引力有限。经济数据可能企稳好转，权益市场有望走出较好行情；偏股型和平衡型转债有望跑赢偏债型品种。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 03 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 0.9602 元，份额累计净值为 0.9602 元，本基金 C 类基金份额净值为 0.9555 元，份额累计净值为 0.9555 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.74%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 0.65%，同期业绩基准增长率为 1.81%。

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	28,482,915.32	18.92
	其中：股票	28,482,915.32	18.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	120,444,887.60	80.02
	其中：债券	120,444,887.60	80.02
	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	1,544,883.91	1.03
8	其他各项资产	42,039.72	0.03
9	合计	150,514,726.55	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

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	-	-
B	采矿业	7,796,857.00	5.49
C	制造业	20,686,058.32	14.57
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	28,482,915.32	20.06

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

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	601899	紫金矿业	446,000	7,501,720.00	5.28
2	688032	禾迈股份	30,936	6,670,420.32	4.70
3	300260	新莱应材	191,000	5,283,060.00	3.72
4	603606	东方电缆	109,600	4,853,088.00	3.42
5	301030	仕净科技	69,500	3,879,490.00	2.73
6	601168	西部矿业	15,300	295,137.00	0.21

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	110,096,660.28	77.53
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	10,348,227.32	7.29
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	120,444,887.60	84.82

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	019703	23 国债 10	578,000	58,924,328.77	41.50
2	019727	23 国债 24	495,000	50,161,130.14	35.32
3	102100630	21 长电 MTN001	100,000	10,348,227.32	7.29
4	019709	23 国债 16	10,000	1,011,201.37	0.71

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	42,039.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	42,039.72

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 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

本基金本报告期末未持有基金。

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）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	-	-
开放式基金认购手续费	-	-
基金交易费用(元)	-	-

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)、销售服务费等销售费用,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	博时恒耀债券A	博时恒耀债券C
本报告期期初基金份额总额	134,560,663.53	23,106,269.90
报告期期间基金总申购份额	291,222.85	2,884,569.44
减:报告期期间基金总赎回份额	8,452,766.86	4,394,541.81
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	126,399,119.52	21,596,297.53

§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 3 月 31 日，博时基金公司共管理 372 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 15475 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 5694 亿元人民币，累计分红逾 1971 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恒耀债券型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时恒耀债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时恒耀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、博时恒耀债券型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时恒耀债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

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
二〇二四年四月二十二日