

博道盛彦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:中国邮政储蓄银行股份有限公司

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	4
§4 管理人报告	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	7
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	8
4.5 报告期内基金的业绩表现	9
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	9
§5 投资组合报告	10
5.1 报告期末基金资产组合情况	10
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	10
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	11
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	12
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	12
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	12
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	13
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	13
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	13
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	13
5.11 投资组合报告附注	13
§6 开放式基金份额变动	14
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	14
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	14
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	15
§8 影响投资者决策的其他重要信息	15
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	15
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	15
§9 备查文件目录	15
9.1 备查文件目录	16
9.2 存放地点	16
9.3 查阅方式	16

§ 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	博道盛彦混合
基金主代码	012124
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年06月01日
报告期末基金份额总额	417,276,191.47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投资回报和基金资产的长期稳健增值。
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。本基金采用自下而上的积极选股策略，定性和定量相结合的方式分析行业景气程度变化、个股基本面和估值水平，选择具备长期竞争优势和投资潜力的个股进行投资。此外，本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，本基金将重点关注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。本基金债券投资策略主要包括久期管理策略、期限结构配置策略、类属配置策略、个券选择等积极的投资策略。本基金的可转换债券和可交换债券投资策

	略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略和存托凭证投资策略详见法律文件。	
业绩比较基准	中证800指数收益率×60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×15%+中债综合全价(总值)指数收益率×25%	
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	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博道盛彦混合A	博道盛彦混合C
下属分级基金的交易代码	012124	012125
报告期末下属分级基金的份额总额	399,124,417.82份	18,151,773.65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(2022年01月01日 - 2022年03月31日)	
	博道盛彦混合A	博道盛彦混合C
1. 本期已实现收益	-12,734,568.16	-586,498.95
2. 本期利润	-85,897,475.40	-3,779,510.11
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2074	-0.2062
4. 期末基金资产净值	325,407,550.94	14,737,787.49
5. 期末基金份额净值	0.8153	0.8119

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

博道盛彦混合A净值表现

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	-20.17%	2.00%	-10.19%	1.14%	-9.98%	0.86%
过去六个月	-14.92%	1.55%	-9.86%	0.89%	-5.06%	0.66%
自基金合同生效起至今	-18.47%	1.34%	-14.56%	0.84%	-3.91%	0.50%

博道盛彦混合C净值表现

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	-20.27%	2.00%	-10.19%	1.14%	-10.08%	0.86%
过去六个月	-15.14%	1.55%	-9.86%	0.89%	-5.28%	0.66%
自基金合同生效起至今	-18.81%	1.34%	-14.56%	0.84%	-4.25%	0.50%

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

博道盛彦混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年06月01日-2022年03月31日)



注：本基金基金合同生效日为 2021 年 6 月 1 日，建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。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。

博道盛彦混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年06月01日-2022年03月31日)



注：本基金基金合同生效日为 2021 年 6 月 1 日，建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。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	2021-06-01	-	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。

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，宏观环境复杂严峻，不确定性明显增加，大宗商品价格暴涨，权益市场出现持续大幅下跌，其中，沪深300下跌14.53%，中证500下跌14.06%，创业板下跌19.96%，恒生指数下跌5.99%，基金重仓指数下跌17.79%。从行业来看，煤炭表现较好，房地产、农林牧渔、银行相对抗跌，电子、国防军工、家电、汽车跌幅较大，均超过20%。

当前宏观环境严峻复杂，海外地缘政治冲突升级，流动性紧缩预期加剧，国内疫情发生频次有所增多，经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力，估值和基本面的不确定性都有所抬升，对风险资产尤其是成长风格的资产形成压制。国内来看，政策从2021年12月的中央经济工作会议以来已经开始应对，但是，一方面，政策发力到周期下行趋势扭转具有时滞，经济和盈利企稳信号仍有待验证，另一方面，新的国内国际局势也使得“稳增长”难度有所加大，国内疫情发生规模和频次超预期，压制和推迟了消费的“正常化”修复，大宗商品涨价叠加需求走弱，导致中游制造盈利受到挤压。

本季度市场的调整幅度与速度显著的超出了本基金经理预期。站在去年底，由于今年是稳增长的年份，流动性也会合理充裕，估值上也是总体合理，部分行业结构性高估，因此预判今年更多是高估行业的结构性调整而出现系统性风险的概率较小。但从结果看，市场普跌的现象较为明显，这也再次印证了判断短期市场走势的难度。由于本组合在本季度维持了较高的仓位，因此组合净值也遭受了一定程度的回调。从归因来看，港股和半导体两个板块给组合带来了较大的负收益，新能源板块由于在估值的衡量标准下，从去年四季度开始持续进行了一定的减仓和换股动作，因此受损幅度相对较小。

随着市场的下跌程度加大，投资者悲观情绪蔓延后，市场担忧的主体变成了一些似是而非的宏观层面因素，例如俄乌战争不可控下对类似70年代石油危机时长期滞胀的担忧、担心逆全球化下金融脱钩后估值体系的崩塌、人口周期下类似日本“失去二十年”的担忧。从A股历史上的每次市场周期复盘来看，每次经过市场的大幅下跌后，市场总会周期性地充斥着各种“宏大叙事”般的担忧，且这些担忧虽然事后都证明是杞人忧天，但在当时都是短期难以证伪的。坦率地说，我们也较难判断上述担忧证伪的具体时点，但从组合管理来看，本基金经理认为有几个原则是可以去坚持的：首先，当“自下而上”的企业微观事实与“自上而下”的宏观判断有冲突时，坚定地站在微观事实这一边，就像巴菲特说的“多关注庄稼地，而不是总关心天气”。外部环境是会动态调整的，优秀的企业家具备前瞻性眼光和良好的适应性，因此优质的公司是我们投资者在弱市中抵御各种不确定性的根本。其次，估值是持股底气的最大来源之一。很少有人能准确判断市场上上涨的转折点，正如“若要见到彩虹，闪电打下来的时候也得在场”。在弱市中，特别是市场底部区域，波动和回撤是难免的，但此时只能去被动接受，因为此时的风险收益比是好的。因此，坚守有估值性价比的公司耐心等待，在当下可能比判断右侧拐点何时到来更有意义。

我们相信，风险是涨出来的，价值是跌出来的。在市场情绪悲观的时候，我们不妨多一点乐观主义，相信中国经济长期的增长潜力，相信中国优秀公司风雨中成长的能力，以常识去克服情绪，以具备吸引力的价格，坚定持有或买入优秀的公司。3月份的金融稳定发展委员会会议回应了宏观经济、房地产、中概股、平台经济治理及香港金融市场稳定等方面的市场关切，我们相信后续应该也会有更多可执行的配套政策出台。随着经济在未来的触底企稳，上市公司盈利和投资者风险偏好应该也会跟随好转。行业配置上，我们对互联网、科技、高端制造继续保持偏好，认为经过最近两个季度的调整后估值均已进入合理区间，同时，从逆向的角度，对部分医疗子行业也开始提起关注热情。

本基金管理人将着力挖掘长期经济转型中的优秀公司，继续坚持以合理价格买入优秀公司的运作思路，秉持勤勉尽责，力争为投资者获得有竞争力的超额收益。

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	301,831,617.64	88.41
	其中：股票	301,831,617.64	88.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	22,682,031.00	6.64
	其中：债券	22,682,031.00	6.64
	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	8,000,000.00	2.34
	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	8,161,943.34	2.39
8	其他资产	723,149.52	0.21
9	合计	341,398,741.50	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	193,708,332.82	56.95
D	电力、热力、燃气及水生 生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	73,917.35	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	8,002,070.00	2.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,874,045.28	0.84
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,193.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	2,572,877.52	0.76
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	3,489,156.69	1.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	210,731,593.44	61.95

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	975,547.71	0.29
可选消费	24,495,551.40	7.20
信息技术	29,805,587.46	8.76
通信服务	35,823,337.63	10.53
合计	91,100,024.20	26.78

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	00700	腾讯控股	106,100	32,199,221.85	9.47
2	01810	小米集团-W	2,163,400	24,458,274.13	7.19

3	000938	紫光股份	1,073,100	20,979,105.00	6.17
4	03690	美团-W	153,600	19,383,268.76	5.70
5	603986	兆易创新	135,800	19,151,874.00	5.63
6	600519	贵州茅台	10,800	18,565,200.00	5.46
7	600745	闻泰科技	203,600	16,552,680.00	4.87
8	600460	士兰微	310,500	15,059,250.00	4.43
9	000100	TCL科技	2,288,200	11,235,062.00	3.30
10	688311	盟升电子	177,600	10,034,400.00	2.95

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	21,847,973.08	6.42
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）	834,057.92	0.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	22,682,031.00	6.67

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	019654	21国债06	107,500	10,991,253.56	3.23
2	019664	21国债16	107,500	10,856,719.52	3.19
3	110081	闻泰转债	7,040	834,057.92	0.25

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

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 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) 2021年4月28日，腾讯控股有限公司（股票代码00700）因收购Bitauto Holdings Limited、上海阑途信息技术有限公司股权分别构成未依法申报违法实施的经营者集中，收到市场监管总局各处以罚款50万元的行政处罚（国市监处〔2021〕30号、国市监处〔2021〕31号）。

2021年4月，市场监管总局依据《反垄断法》对美团（股票代码03690）在中国境内网络餐饮外卖平台服务市场滥用市场支配地位行为立案调查。根据《反垄断法》第四十七条、第四十九条规定，综合考虑美团违法行为的性质、程度和持续时间等因素，2021年10月8日，市场监管总局依法作出行政处罚决定，责令美团停止违法行为，全额退还独家合作保证金12.89亿元，并处以其2020年中国境内销售额1147.48亿元3%的罚款，计34.42亿元（国市监处罚〔2021〕74号）。同时，向美团发出《行政指导书》（国市监行指〔2021〕2号），要求其围绕完善平台佣金收费机制和算法规则、维护平台内中小餐饮商家合法利益、加强外卖骑手合法权益保护等进行全面整改，并连续三年向市场监管总局提交自查合规报告，确保整改到位，实现规范创新健康持续发展。

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	614,641.64
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	108,507.88
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	723,149.52

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	110081	闻泰转债	834,057.92	0.25

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

	博道盛彦混合A	博道盛彦混合C
报告期期初基金份额总额	425,906,493.76	18,282,979.23
报告期期间基金总申购份额	8,060,614.99	1,605,690.85
减：报告期期间基金总赎回份额	34,842,690.93	1,736,896.43
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	399,124,417.82	18,151,773.65

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

	博道盛彦混合A	博道盛彦混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	2,000,400.18	1,000,500.00
报告期期间买入/申购总份额	2,068,930.35	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,069,330.53	1,000,500.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.02	5.51

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

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2022-01-25	2,068,930.35	2,000,000.00	0.0005
合计			2,068,930.35	2,000,000.00	

注：本基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

§ 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彦混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道盛彦混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道盛彦混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道盛彦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彦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、报告期内博道盛彦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