

# 博时恒泰债券型证券投资基金（博时恒泰债券E）基金产品资料概要更新

编制日期：2026年6月25日

送出日期：2026年6月26日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。  
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

## 一、产品概况

基金简称	博时恒泰债券	基金代码	011864
下属基金简称	博时恒泰债券E	下属基金代码	023310
基金管理人	博时基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2021-04-22		
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日开放申购、赎回
基金经理	静鹏	开始担任本基金基金经理的日期	2024-12-20
		证券从业日期	2012-06-01
	唐薇	开始担任本基金基金经理的日期	2025-06-25
		证券从业日期	2013-08-01
张李陵	开始担任本基金基金经理的日期	2021-04-22	
	证券从业日期	2012-07-01	
其他条款	基金合同生效后，连续50个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会。		

注：本基金E类基金份额于2025年3月7日生效。

## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

敬请投资者阅读更新的《招募说明书》中“基金的投资”章节了解详细情况

投资目标	本基金在控制风险的前提下，以获取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。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、

债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换债、公开发行的次级债等）、资产支持证券、货币市场工具、银行存款、同业存单、债券回购、国债期货、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%，投资于股票等资产的比例不超过基金资产的20%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的0%-50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约所需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

## 主要投资策略

本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略三个部分内容。其中，资产配置投资策略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。本基金资产配置不仅考虑宏观基本面的影响因素同时考虑市场情绪、同业基金仓位水平的影响，并根据市场情况作出应对措施。资产配置层面重在系统性风险的规避。本基金将基于既定的投资策略，充分衡量风险收益比后作出投资决策。股票投资策略以实现绝对收益为目标，结合定量、定性分析，考察和筛选未被充分定价的、具备增长潜力的个股，建立本基金的初选股票池。在股票投资上，本基金将在符合经济发展规律、有政策驱动的、推动经济结构转型的新的增长点和产业中，以自下而上的个股选择为主，重点关注公司以及所属产业的成长性与商业模式。本基金采用的债券投资策略包括：期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、可转换债券投资策略等。其他资产投资策略有衍生产品投资策略、资产支持证券投资策略、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

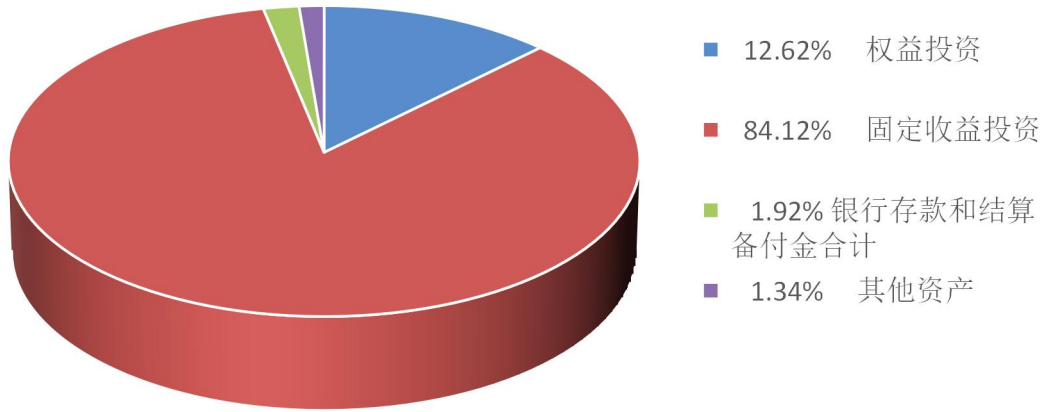
中债综合全价（总值）指数收益率×90%+沪深300指数收益率×5%+恒生综合指数收益率×5%。

## 风险收益特征

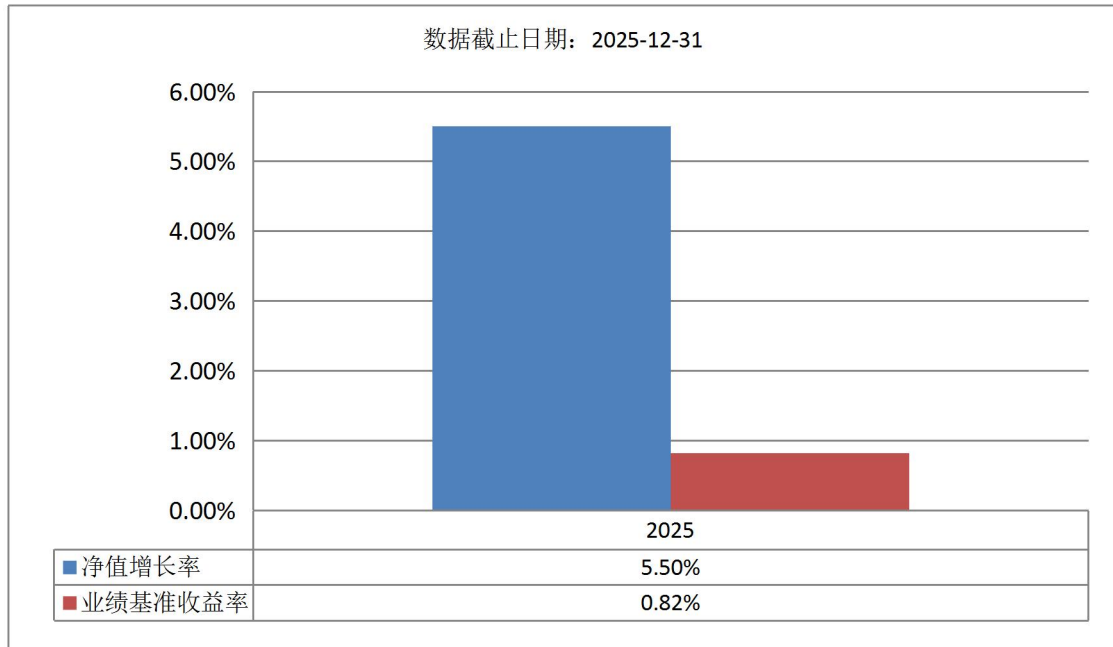
本基金是债券型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金，属于中等预期风险、中等预期收益的基金产品。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

## （二）投资组合资产配置图表/区域配置图表 投资组合资产配置图表

数据截止日期：2026-03-31



### (三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：基金的过往业绩不代表未来表现。本基金份额生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

## 三、投资本基金涉及的费用

### (一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
赎回费	N < 7 天	1.50%	100%计入资产
	N ≥ 7 天	0.00%	

注：赎回费持有期：对于每份申购份额，持有期指自该基金份额申购确认日至赎回确认日（不含该日）。

**申购费：**

本基金 E 类基金份额不收取申购费

## (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	固定比例 0.60%	基金管理人、销售机构
托管费	固定比例 0.15%	基金托管人
销售服务费	固定比例 0.01%	销售机构
审计费用	70,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊
其他费用	基金合同生效后与本基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用等，详见招募说明书或其更新“基金的费用与税收”章节。	

注：1、本基金交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、本基金运作相关费用年金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

## (三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

	基金运作综合费率（年化）
基金运作综合费率	0.77%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率均为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

## 四、风险揭示与重要提示

### (一) 风险揭示

**本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。**

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

投资者应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等法律文件，及时关注本公司出具的适当性意见，各销售机构关于适当性的意见不必然一致，本公司的适当性匹配意见并不表明对基金的风险和收益做出实质性判断或者保证。基金合同中关于基金风险收益特征与基金风险等级因考虑因素不同而存在差异。投资者应了解基金的风险收益情况，结合自身投资目的、期限、投资经验及风险承受能力谨慎决策并自行承担风险，不应采信不符合法律法规要求的销售行为及违规宣传推介材料。

#### 1. 特有风险

##### (1) 港股通机制下，港股投资风险

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括港股通标的股票，除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

##### (2) 国债期货等金融衍生品投资风险

金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

本基金投资国债期货，国债期货市场的风险类型较为复杂，涉及面广，具有放大性与可预防性等特征。其风险主要有由利率波动原因造成的市场价格风险、由宏观因素和政策因素变化而引起的系统风险、由市场和资金流动性

原因引起的流动性风险、由交易制度不完善而引发的制度性风险以及由技术系统故障及操作失误造成的技术系统风险等。

### (3) 基金投资资产支持证券的风险

资产支持证券 (ABS) 是一种债券性质的金融工具, 其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同, 资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权, 而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权, 是一种以资产信用为支持的证券, 所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等。

### (4) 基金投资信用衍生品的风险

本基金可以投资于信用衍生品, 由于信用衍生品市场价值随着市场因素的变化而变化, 当信用衍生品价值为正时面临交易对手违约的风险。信用衍生品主要场外市场交易, 产品自身的流动性不高, 此时倘若市场中发生交易对手违约或者信用评级被降级等信用事件, 将会降低产品的流动性, 使得产品的流动性溢价提高。信用衍生品本身高杠杆的特点, 有时即为微小的失误可能带来风险的急剧放大, 信用衍生品在估值、风险对冲方面存在模型风险。

(5) 基金存续期内, 连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的, 基金合同终止, 不需召开基金份额持有人大会。因此本基金有面临自动清算的风险。

2、本基金普通风险: 市场风险 (政策风险、经济周期风险、收益波动风险、利率风险、通货膨胀风险、再投资风险等)、管理风险、操作风险、信用风险、流动性风险、合规风险和其他风险。

## (二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册, 并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证, 也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。基金投资者自依基金合同取得基金份额, 即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。基金产品资料概要信息发生重大变更的, 基金管理人将在三个工作日内更新。其他信息发生变更的, 基金管理人每年更新一次。因此, 本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后, 如需及时、准确获取基金的相关信息, 敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址: <https://www.bosera.com>][客服电话: 95105568]

- (1) 基金合同、托管协议、招募说明书
- (2) 定期报告, 包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- (3) 基金份额净值
- (4) 基金销售机构及联系方式
- (5) 其他重要资料

## 六、其他情况说明

**争议解决方式:** 各方当事人同意, 因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议, 如不愿或者不能通过协商、调解解决的, 任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会, 按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的, 对双方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定, 仲裁费用由败诉方承担。争议处理期间, 基金管理人、基金托管人应恪守基金管理人和基金托管人职责, 各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务, 维护基金份额持有人的合法权益。《基金合同》受中国法律 (为本基金合同之目的, 在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律) 管辖。