

# 博时广利纯债债券型证券投资基金

## 更新招募说明书

### 2018 年第 1 号

博时广利纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的发行已获中国证监会证监许可[2016]1986号文批准。自 2017 年 2 月 6 日至 2017 年 2 月 13 日通过销售机构公开发售。本基金为契约型开放式，存续期间为不定期。本基金的基金合同于 2017 年 2 月 16 日正式生效。

#### 【重要提示】

1、本基金根据2016年8月30日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予博时广利纯债债券型证券投资基金募集注册的批复》（证监许可[2016]1986号），进行募集。

2、基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

3、投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

4、本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

本基金投资中小企业私募债券，中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

5、本基金为债券型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于股票型、混合型基金，属于证券投资基金中的中低预期风险/收益品种。

6、本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

7、基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

8、本基金初始募集面值为人民币1.00元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于初始面值，本基金投资者有可能出现亏损。

9、基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

10、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。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2018年2月17日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年12月31日（财务数据未经审计）。

# 一、基金管理人

## 一、基金管理人概况

名称： 博时基金管理有限公司

住所： 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

办公地址： 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

法定代表人： 张光华

成立时间： 1998 年 7 月 13 日

注册资本： 2.5 亿元人民币

存续期间： 持续经营

联系人： 韩强

联系电话： (0755) 8316 9999

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准设立。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份 49%；中国长城资产管理公司，持有股份 25%；天津港（集团）有限公司，持有股份 6%；上海汇华实业有限公司，持有股份 12%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份 6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份 2%。注册资本为 2.5 亿元人民币。

公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设两大总部和二十九个直属部门，分别是：权益投资总部、固定收益总部以及宏观策略部、交易部、指数与量化投资部、特定资产管理部、多元资产管理部、年金投资部、绝对收益投资部、产品规划部、营销服务部、客户服务中心、市场部、养老金业务中心、战略客户部、机构-上海、机构-南方、券商业务部、零售-北京、零售-上海、零售-南方、央企业务部、互联网金融部、董事会办公室、办公室、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、风险管理部和监察法律部。

权益投资总部负责公司所管理资产的权益投资管理及相关工作。权益投资总部下设股票投资部（含各投资风格小组）、研究部。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。研究部负责完成对宏观经济、投资策略、行业上市公司及市场的研究。固定收益总部负责公司所管理资产的固定收益投资管理及相关工作。固定收益总部下设现金管理组、公募基金组、专户组、国际组和研究组，分别负责各类固定收益资产的研究和投资工作。

市场部负责公司市场和销售管理、销售组织、目标和费用管理、销售督导与营销培训管理、公司零售渠道银行总行管理与维护、推动金融同业业务合作与拓展、国际业务的推动与协作等工作。战略客户部负责北方地区由国资委和财政部直接管辖企业以及该区域机

构客户的销售与服务工作。机构-上海和机构-南方分别主要负责华东地区、华南地区以及其他指定区域的机构客户销售与服务工作。养老金业务中心负责公司社保基金、企业年金、基本养老金及职业年金的客户拓展、销售与服务、养老金研究与政策咨询、养老金销售支持与中台运作协调、相关信息服务等工作。券商业务部负责券商渠道的开拓和销售服务。零售-北京、零售-上海、零售-南方负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。央企业务部负责招商局集团签约机构客户、重要中央企业及其财务公司等客户的拓展、合作业务落地与服务等工作。营销服务部负责营销策划、销售支持、品牌传播、对外媒体宣传等工作。

宏观策略部负责为投委会审定资产配置计划提供宏观研究和策略研究支持。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。指数与量化投资部负责公司各类指数与量化投资产品的研究和投资管理工作。特定资产管理部负责公司权益类特定资产专户和权益类社保投资组合的投资管理及相关工作。多元资产管理部负责公司的基金中基金投资产品的研究和投资管理工作。年金投资部负责公司所管理企业年金等养老金资产的投资管理及相关工作。绝对收益投资部负责公司绝对收益产品的研究和投资管理工作。产品规划部负责新产品设计、新产品报批、主管部门沟通维护、产品维护以及年金方案设计等工作。互联网金融部负责公司互联网金融战略规划的设计和实施，公司互联网金融的平台建设、业务拓展和客户运营，推动公司相关业务在互联网平台的整合与创新。客户服务中心负责零售客户的服务和咨询工作。

董事会办公室专门负责股东会、董事会、监事会及董事会各专业委员会各项会务工作；股东关系管理与董、监事的联络、沟通及服务；基金行业政策、公司治理、战略发展研究、公司文化建设；与公司治理及发展战略等相关的重大信息披露管理；政府公共关系管理；党务工作；博时慈善基金会的管理及运营等。办公室负责公司的行政后勤支持、会议及文件管理、外事活动管理、档案管理及工会工作等。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、员工沟通、人力资源信息管理工作。财务部负责公司预算管理、财务核算、成本控制、财务分析等工作。信息技术部负责信息系统开发、网络运行及维护、IT 系统安全及数据备份等工作。基金运作部负责基金会计和基金注册登记等业务。风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察，并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。

另设北京分公司、上海分公司、沈阳分公司、郑州分公司和成都分公司，分别负责对驻京、沪、沈阳、郑州和成都人员日常行政管理和对赴京、沪、沈阳和郑州处理公务人员给予协助。此外，还设有全资子公司博时资本管理有限公司，以及境外子公司博时基金（国际）有限公司。

截止到 2017 年 12 月 31 日，公司总人数为 527 人，其中研究员和基金经理超过 89%拥有硕士及以上学位。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

## 二、主要成员情况

### 1、基金管理人董事会成员

张光华先生，博士，董事长。历任国家外汇管理局政研室副主任，计划处处长，中国人民银行海南省分行副行长、党委委员，中国人民银行广州分行副行长、党委副书记，广东发展银行行长、党委副书记，招商银行副行长、执行董事、副董事长、党委副书记，在招商银行任职期间曾兼任永隆银行副董事长、招商基金管理有限公司董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长、招银国际金融有限公司董事长、招银金融租赁有限公司董事长。2015 年 8 月起，任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人。

江向阳先生，董事。2015 年 7 月起任博时基金管理有限公司总经理。中共党员，南开大学国际金融博士，清华大学金融媒体 EMBA。1986-1990 年就读于北京师范大学信息与情报学系，获学士学位；1994-1997 年就读于中国政法大学研究生院，获法学硕士学位；2003-2006 年，就读于南开大学国际经济研究所，获国际金融博士学位。2015 年 1 月至 7 月，任招商局金融集团副总经理、博时基金管理有限公司党委副书记。历任中国证监会办公厅、党办副主任兼新闻办（网信办）主任；中国证监会办公厅副巡视员；中国证监会深圳专员办处长、副专员；中国证监会期货监管部副处长、处长；中国农业工程研究设计院情报室干部。

彭磊女士，分别于 1994 年 7 月及 2010 年 7 月获得西南财经大学企业管理专业经济学学士学位，以及北京大学金融学专业经济学硕士学位。曾在不同证券和金融类公司担任管理或行政职位，拥有相关管理和从业经验。于 2002 年 5 月至 2003 年 10 月兼任友联资产管理公司执行董事。于 2002 年 5 月加入招商局金融集团有限公司，历任综合管理部副总经理、审计稽核部总经理、中国业务部总经理、证券部总经理、总经理助理。自 2011 年 6 月起担任长城证券股份有限公司董事；自 2015 年 3 月起担任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司董事；自 2016 年 4 月起担任招商局金融集团有限公司副总经理。

王金宝先生，硕士，董事。1988 年 7 月至 1995 年 4 月在上海同济大学数学系工作，任教师。1995 年 4 月进入招商证券，先后任上海澳门路营业部总经理、上海地区总部副总经理（主持工作）、投资部总经理、投资部总经理兼固定收益部总经理、股票销售交易部总经理（现更名为机构业务总部）、机构业务董事总经理。2002 年 10 月至 2008 年 7 月，

任博时基金管理有限公司第二届、第三届监事会监事。2008年7月起，任博时基金管理有限公司第四届至第六届董事会董事。

陈克庆先生，北京大学工商管理硕士。2001年起历任世纪证券投资银行北京总部副总经理，国信证券投行业务部副总经理，华西证券投资银行总部副总经理、董事总经理。2014年加入中国长城资产管理公司，现任投资投行事业部副总经理。

张灏先生，1978年生，学士。2000年毕业于美国麻省理工学院，获得数学学士学位和经济学学士学位。2000年起，任职于瑞士信贷（CSFB）纽约办公室并加入企业并购部门担任经理，负责全球电讯及消费零售行业的并购项目；2005年，加入摩根大通（JP Morgan）香港办公室担任副总裁，负责大中华区的企业并购项目；2008年，加入著名基金公司德劭集团（DE Shaw & Co.）之大中华区私募股权投资部门担任执行董事。2013年至今，加入上海信利股权投资基金管理有限公司担任董事及上海汇华实业有限公司担任投资总监，并负责股权投资项目管理。

顾立基先生，硕士，独立董事。1968年至1978年就职于上海印染机械修配厂，任共青团总支书记；1983年起，先后任招商局蛇口工业区管理委员会办公室秘书、主任；招商局蛇口工业区免税品有限公司董事总经理；中国国际海运集装箱股份有限公司董事副总经理、总经理；招商局蛇口工业区有限公司副总经理、国际招商局贸易投资有限公司董事副总经理；蛇口招商港务股份有限公司董事总经理；招商局蛇口工业区有限公司董事总经理；香港海通有限公司董事总经理；招商局科技集团有限公司董事总经理、招商局蛇口工业区有限公司副总经理。2008年退休。2008年2月至今，任清华大学深圳研究生院兼职教授；2008年11月至2010年10月，兼任招商局科技集团有限公司执行董事；2009年6月至今，兼任中国平安保险（集团）股份有限公司外部监事、监事会主席；2011年3月至今，兼任湘电集团有限公司外部董事；2013年5月至2014年8月，兼任德华安顾人寿保险有限公司（ECNL）董事；2013年6月至今，兼任深圳市昌红科技股份有限公司独立董事。2014年11月起，任博时基金管理有限公司第六届董事会独立董事。

姜立军先生，1955年生，会计师，工商管理硕士（MBA）。1974年12月参加工作，历任中国远洋运输总公司财务处科员、中国-坦桑尼亚联合海运服务公司财务部经理、日本中铃海运服务公司财务部经理、中远（英国）公司财务部经理、香港益丰船务公司财务部经理、香港-佛罗伦租箱公司（香港上市公司）副总经理、中远太平洋有限公司（香港上市公司）副总经理、中远日本公司财务部长和营业副本部长、中远集装箱运输有限公司副总会计师等职。2002.8-2008.7，任中远航运股份有限公司（A股上市公司）首席执行官、董事。2008.8-2011.12，任中远投资（新加坡）有限公司（新加坡上市公司）总裁、董事会

副主席、中远控股（新加坡）有限公司总裁；并任新加坡中资企业协会会长。2011.11-2015.12，任中国远洋控股股份有限公司执行（A+H 上市公司）执行董事、总经理。2012.2-2015.12，兼任中国上市公司协会副监事长、天津上市公司协会副会长；2014.9-2015.12，兼任中国上市公司协会监事会专业委员会副主任委员。

赵如冰先生，1956 年生，教授级高级工程师，国际金融专业经济学硕士研究生。历任葛洲坝水力发电厂工作助理工程师、工程师、高级工程师、葛洲坝二江电厂电气分厂主任、书记；1989.09—1991.10 任葛洲坝至上海正负 50 万伏超高压直流输电换流站书记兼站长，主持参加了我国第一条亚洲最大的直流输电工程的安装调试和运行；1991.10—1995.12 任厂办公室主任兼外事办公室主任；1995.12—1999.12，任华能南方开发公司党组书记、总经理，兼任中国华能集团董事、深圳南山热电股份有限公司（上市公司代码 0037）副董事长、长城证券有限责任公司副董事长、深圳华能电讯有限公司董事长；2000.01-2004.07，华能南方公司被国家电力公司重组后，任华能房地产开发公司副总经理，长城证券有限责任公司副董事长、董事；2004.07-2009.03，任华能房地产开发公司党组书记、总经理；2009.12-2016.8,任景顺长城基金管理公司董事长、景顺长城资产管理（深圳）公司董事长；2016.8-至今，任阳光资产管理股份有限公司副董事长；兼任西南证券、百隆东方、威华股份独立董事。

## 2、基金管理人监事会成员

车晓昕女士，硕士，监事。1983 年起历任郑州航空工业管理学院助教、讲师、珠海证券有限公司经理、招商证券股份有限公司投资银行总部总经理。现任招商证券股份有限公司财务管理董事总经理。2008 年 7 月起，任博时基金管理有限公司第四至六届监事会监事。

陈良生先生，中央党校经济学硕士。1980 年至 2000 年就职于中国农业银行巢湖市支行及安徽省分行。2000 年起就职于中国长城资产管理公司，历任合肥办事处综合管理部部长、福州办事处党委委员、总经理、福建省分公司党委书记、总经理。2017 年 4 月至今任中国长城资产管理股份有限公司机构协同部专职董监事。2017 年 6 月起任博时基金管理有限公司监事。

赵兴利先生，硕士，监事。1987 年至 1995 年就职于天津港务局计财处。1995 年至 2012 年 5 月先后任天津港贸易公司财务科科长、天津港货运公司会计主管、华夏人寿保险股份有限公司财务部总经理、天津港财务有限公司常务副总经理。2012 年 5 月筹备天津港

(集团)有限公司金融事业部, 2011年11月至今任天津港(集团)有限公司金融事业部副部长。2013年3月起, 任博时基金管理有限公司第五至六届监事会监事。

郑波先生, 博士, 监事。2001年起先后在中国平安保险公司总公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司人力资源部总经理。2008年7月起, 任博时基金管理有限公司第四至六届监事会监事。

黄健斌先生, 工商管理硕士。1995年起先后在广发证券有限公司、广发基金管理有限责任公司投资管理部、中银国际基金管理有限公司基金管理部工作。2005年加入博时基金管理公司, 历任固定收益部基金经理、博时平衡配置混合型基金经理、固定收益部副总经理、社保组合投资经理、固定收益部总经理。现任公司总经理助理兼固定收益总部董事总经理、年金投资部总经理、社保组合投资经理、高级投资经理、兼任博时资本管理有限公司董事。2016年3月18日至今担任博时基金管理有限公司监事会员工监事。

严斌先生, 硕士, 监事。1997年7月起先后在华侨城集团公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司财务部总经理。2015年5月起, 任博时基金管理有限公司第六届监事会监事。

### 3、高级管理人员

张光华先生, 简历同上。

江向阳先生, 简历同上。

王德英先生, 硕士, 副总经理。1995年起先后在北京清华计算机公司任开发部经理、清华紫光股份公司CAD与信息事业部任总工程师。2000年加入博时基金管理有限公司, 历任行政管理部副经理, 电脑部副经理、信息技术部总经理、公司代总经理。现任公司副总经理, 主管IT、运作、指数与量化投资等工作, 博时基金(国际)有限公司及博时资本管理有限公司董事。

董良泓先生, CFA, MBA, 副总经理。1993年起先后在中国技术进出口总公司、中技上海投资公司、融通基金管理有限公司、长城基金管理有限公司从事投资管理工作。2005年2月加入博时基金管理有限公司, 历任社保股票基金经理, 特定资产高级投资经理, 研究部总经理兼特定资产高级投资经理、社保股票基金经理、特定资产管理部总经理、博时资本管理有限公司董事。现任公司副总经理兼高级投资经理、社保组合投资经理, 兼任博时基金(国际)有限公司董事。

邵凯先生, 经济学硕士, 副总经理。1997年至1999年在河北省经济开发投资公司从事投资管理工作。2000年8月加入博时基金管理有限公司, 历任债券组合经理助理、债券组合经理、社保债券基金基金经理、固定收益部副总经理兼社保债券基金基金经理、固定收益部总经理、固定收益投资总监、社保组合投资经理。现任公司副总经理、兼任博时基金(国际)有限公司董事、博时资本管理有限公司董事。



徐卫先生，硕士，副总经理。1993年起先后在深圳市证券管理办公室、中国证监会、摩根士丹利华鑫基金工作。2015年6月加入博时基金管理有限公司，现任公司副总经理兼博时资本管理有限公司董事、博时基金(国际)有限公司董事。

孙麒清女士，商法学硕士，督察长。曾供职于广东深港律师事务所。2002年加入博时基金管理有限公司，历任监察法律部法律顾问、监察法律部总经理。现任公司督察长，兼任博时基金(国际)有限公司董事、博时资本管理有限公司副董事长。

#### 4、本基金基金经理

杨永光先生，硕士。1993年至1997年先后在桂林电器科学研究所、深圳迈瑞生物医疗电子股份公司工作。2001年起在国海证券历任债券研究员、债券投资经理助理、高级投资经理、投资主办人。2011年加入博时基金管理有限公司，历任博时稳定价值债券基金(2014.2.13-2015.5.22)、上证企债30ETF基金(2013.7.11-2016.4.25)、博时天颐债券基金(2012.2.29-2016.8.1)、博时招财一号保本基金(2015.4.29-2016.8.1)、博时新机遇混合基金(2015.9.11-2016.9.29)的基金经理、固定收益总部公募基金组投资副总监、股票投资部绝对收益组投资副总监。现任绝对收益投资部副总经理兼博时优势收益信用债券基金(2014.9.15-至今)、博时境源保本混合基金(2015.12.18-至今)、博时保泽保本混合基金(2016.4.7-至今)、博时景兴纯债债券基金(2016.5.20-至今)、博时保丰保本混合基金(2016.6.6-至今)、博时保泰保本混合基金(2016.6.24-至今)、博时招财二号保本基金(2016.8.9-至今)、博时富宁纯债债券基金(2016.8.17-至今)、博时富益纯债债券基金(2016.11.4-至今)、博时臻选纯债债券基金(2016.11.7-至今)、博时富华纯债债券基金(2016.11.25-至今)、博时泰安债券基金(2016.12.21-至今)、博时鑫丰混合基金(2016.12.27-至今)、博时鑫泰混合基金(2017.1.10-至今)、博时鑫惠混合基金(2017.1.23-至今)、博时聚源纯债债券基金(2017.2.9-至今)、博时广利纯债债券基金(2017.2.16-至今)、博时富瑞纯债债券基金(2017.3.3-至今)、博时富海纯债债券基金(2017.3.6-至今)、博时华盈纯债债券基金(2017.3.9-至今)、博时新机遇混合型证券投资基金(2018.2.6-至今)、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金(2018.2.6-至今)的基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

委员：江向阳、邵凯、黄健斌、李权胜、欧阳凡、魏凤春、王俊、过钧、白仲光

江向阳先生，简历同上。

邵凯先生，简历同上。

黄健斌先生，简历同上。

李权胜先生，硕士。1994年至1998年在北京大学生命科学学院学习，获理学学士学位。1998年至2001年继续就读于北京大学，获理学硕士学位。2013年至2015年就读清华大学-香港中文大学金融MBA项目，获得香港中文大学MBA学位。2001年7月至2003年

12月在招商证券研发中心工作，任研究员；2003年12月至2006年2月在银华基金工作，任基金经理助理。2006年3月加入博时基金管理有限公司，任研究员。2007年3月起任研究部研究员兼任博时精选股票基金经理助理。2008年2月调任特定资产管理部投资经理。2012年8月至2014年12月担任博时医疗保健行业股票型证券投资基金基金经理。2013年12月开始担任博时精选混合型证券投资基金基金经理。现任博时基金权益投资总部董事总经理兼股票投资部总经理，权益投资价值组负责人，公司投资决策委员会成员。

欧阳凡先生，硕士。2003年起先后在衡阳市金杯电缆厂、南方基金工作。2011年加入博时基金管理有限公司，曾任特定资产管理部副总经理、社保组合投资经理助理。现任特定资产管理部总经理兼社保组合投资经理。

魏凤春先生，经济学博士。1993年起先后在山东经济学院、江南证券、清华大学、江南证券、中信建投证券公司工作。2011年加入博时基金管理有限公司，历任投资经理、博时抗通胀增强回报(QDII-FOF)基金、博时平衡配置混合基金的基金经理。现任首席宏观策略分析师兼宏观策略部总经理、多元资产管理部总经理。

王俊先生，硕士，CFA。2008年从上海交通大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、金融地产与公用事业组组长、研究部副总经理、博时国企改革股票基金、博时丝路主题股票基金的基金经理。现任研究部总经理兼博时主题行业混合(LOF)基金、博时沪港深优质企业混合基金、博时沪港深成长企业混合基金、博时沪港深价值优选混合基金、博时新兴消费主题混合基金的基金经理。

过钧先生，硕士，CFA。1995年起先后在上海工艺品进出口公司、德国德累斯顿银行上海分行、美国Lowe's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，历任基金经理、博时稳定价值债券投资基金的基金经理、固定收益部副总经理、博时转债增强债券型证券投资基金、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金、博时裕祥分级债券型证券投资基金、博时双债增强债券型证券投资基金、博时新财富混合型证券投资基金的基金经理。现任董事总经理兼固定收益总部公募基金组投资总监、博时信用债券投资基金、博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)、博时新收益灵活配置混合型证券投资基金、博时新机遇混合型证券投资基金、博时新价值灵活配置混合型证券投资基金、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金、博时鑫源灵活配置混合型证券投资基金、博时乐臻定期开放混合型证券投资基金、博时新起点灵活配置混合型证券投资基金、博时双债增强债券型证券投资基金、博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金、博时鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金、博时鑫和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

白仲光先生，博士。1991年起先后在石家庄无线电九厂、石家庄经济学院、长盛基金、德邦基金、上海金珀资产管理公司工作。2015年加入博时基金管理有限公司，曾任股票投

资部绝对收益组投资总监，现任董事总经理兼绝对收益投资部总经理、年金投资部投资总监。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、 基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：广州农村商业银行股份有限公司（简称“广州农村商业银行”）

住所及办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路1号

首次注册登记日期：2006年10月27日

注册资本：81.53亿元人民币

法定代表人：王继康

基金托管业务批准文号：证监许可[2014]83号

联系人：杨华

电话：（020）28019492

传真：（020）28019340

#### 1、发展概况：

广州农村商业银行前身是成立于1951年、至今已有六十五年发展历史的广州市农村信用合作社，1998年9月市农村信用合作社联合社成立，2006年9月统一法人，2009年12月改制开业。广州农村商业银行规范经营、开拓创新，近年来主要业务发展迅速，综合实力不断增强，主要经营指标居广东省农村合作金融机构首位，业务规模居国内农商行前列。2015年末，广州农村商业银行总资产规模近6000亿元，居国内银行业20多位。目前在全国9省市设立了24家村镇银行，拥有员工8000多人，网点数量居广州同行首位。2015年入选“中国企业500强”；连续6年入选英国《银行家》“全球1000家大银行”，2015年排名第202位。

#### 2、主要人员情况

广州农村商业银行总行设资产托管部，是从事资产托管业务的职能部门，内设业务运营室、监督稽核室、产品营销室、系统管理室，部门全体人员均具备本科以上学历及相关从业经验，高管人员均具备研究生以上学历或高级技术职称。

黄镇辉先生，研究生学历，硕士学位。1997年参加工作，曾任广州市商业银行股份有限公司会计计划资金业务交易员，广发基金管理有限公司货币基金经理，广州市信用合作联社资金业务部交易科经理、副总经理，广州农村商业银行总行金融市场部副总经理、金融同业中心总经理、大连业务中心总经理。2016年2月，担任广州农村商业银行总行资产托管部总经理。

张永东先生，工学博士，FRM，中山大学应用统计、华南师范大学金融专业（数量金融与量化投资方向）兼职硕士生导师，曾任中山大学博士后流动站与广发证券博士后工作站博士后研究员、中山大学管理学院金融投资研究中心特约研究员、广西师范学院信息技术系兼职教授、广发证券研发中心金融工程小组负责人、广发基金管理有限公司筹备组金融工程负责人、易方达基金管理有限公司投资发展部主要筹备人、招商基金管理有限公司产品研发部副总监、华南理工大学副教授、硕士生导师、金鹰基金管理有限公司金融工程部总监、产品研发部总监（兼）、基金经理、投委会委员等职。2014年12月加入广州农村商业银行，担任资产托管部副总经理。

### 3、基金托管业务经营情况

广州农村商业银行于2014年1月9日经中国证监会和中国银监会共同核准，获得证券投资基金托管资格。自成立以来，广州农村商业银行资产托管部秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依托严格的内控管理、先进的营运系统、专业的服务团队和丰富的业务经验，严格履行资产托管人职责，为广大基金份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务。目前托管产品涵盖公募基金、基金专户、银行理财、资管计划、信托计划、股权投资基金等，截至2016年9月末，托管证券投资基金4只，托管资产规模逾6500亿元。

## 三、相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

(1) 博时基金管理有限公司北京分公司及北京直销中心

地址：北京建国门内大街18号恒基中心1座23层

电话：010-65187055

传真：010-65187032、010-65187592

联系人：韩明亮

博时一线通：95105568（免长途话费）

#### 2、代销机构

##### (1) 东莞农村商业银行股份有限公司

|        |                         |
|--------|-------------------------|
| 注册地址：  | 广东省东莞市东城区鸿福东路2号         |
| 办公地址：  | 广东省东莞市东城区鸿福东路2号东莞农商银行大厦 |
| 法定代表人： | 王耀球                     |

|         |   |
|---------|---|
| 联系人:    | 杨亢  |
| 电话:     | 0769-22866270   |
| 传真:     | 0769-22866282   |
| 客户服务电话: | 961122  |
| 网址:     | <a href="http://www.drcbank.com/">http://www.drcbank.com/</a> |

**(2)深圳众禄金融控股股份有限公司**

|         |  |
|---------|--|
| 注册地址:   | 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼  |
| 办公地址:   | 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼  |
| 法定代表人:  | 薛峰   |
| 联系人:    | 童彩平  |
| 电话:     | 0755-33227950  |
| 传真:     | 0755-33227951  |
| 客户服务电话: | 400-678-8887   |
| 网址:     | <a href="https://www.zlfund.cn/">https://www.zlfund.cn/</a> ; <a href="http://www.jjmmw.com">www.jjmmw.com</a> |

**(3)上海天天基金销售有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层  |
| 办公地址:   | 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼  |
| 法定代表人:  | 其实  |
| 联系人:    | 潘世友   |
| 电话:     | 021-54509998  |
| 传真:     | 021-64385308  |
| 客户服务电话: | 400-181-8188  |
| 网址:     | <a href="http://www.1234567.com.cn">http://www.1234567.com.cn</a> |

**(4)上海好买基金销售有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室                             |
| 办公地址:   | 上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室                        |
| 法定代表人:  | 杨文斌   |
| 联系人:    | 张茹  |
| 电话:     | 021-20613610  |
| 客户服务电话: | 400-700-9665  |
| 网址:     | <a href="http://www.ehowbuy.com">http://www.ehowbuy.com</a> |

**(5)蚂蚁（杭州）基金销售有限公司**

|         |                                 |
|---------|---------------------------------|
| 注册地址:   | 杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室 |
| 办公地址:   | 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼   |
| 法定代表人:  | 陈柏青                             |
| 联系人:    | 朱晓超                             |
| 电话:     | 021-60897840                    |
| 传真:     | 0571-26697013                   |
| 客户服务电话: | 400-076-6123                    |

|     |   |
|-----|---|
| 网址: | <a href="http://www.fund123.cn">http://www.fund123.cn</a> |
|-----|---|

**(6) 浙江同花顺基金销售有限公司**

|         |  |
|---------|--|
| 注册地址:   | 杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室                               |
| 办公地址:   | 浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼                           |
| 法定代表人:  | 凌顺平  |
| 联系人:    | 吴杰   |
| 电话:     | 0571-88911818                                      |
| 传真:     | 0571-86800423                                      |
| 客户服务电话: | 400-877-3772                                       |
| 网址:     | <a href="http://www.5ifund.com">www.5ifund.com</a> |

**(7) 北京恒天明泽基金销售有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室                                  |
| 办公地址:   | 北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层                                     |
| 法定代表人:  | 周斌  |
| 联系人:    | 马鹏程   |
| 电话:     | 010-57756074  |
| 传真:     | 010-56810782  |
| 客户服务电话: | 400-786-8868  |
| 网址:     | <a href="http://www.chtfund.com">http://www.chtfund.com</a> |

**(8) 北京钱景基金销售有限公司**

|         |  |
|---------|--|
| 注册地址:   | 北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012                               |
| 办公地址:   | 北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012                               |
| 法定代表人:  | 赵荣春  |
| 联系人:    | 魏争   |
| 电话:     | 010-57418829   |
| 传真:     | 010-57569671   |
| 客户服务电话: | 400-893-6885   |
| 网址:     | <a href="http://www.qianjing.com">www.qianjing.com</a> |

**(9) 深圳富济财富管理有限公司**

|         |  |
|---------|--|
| 注册地址:   | 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室                                 |
| 办公地址:   | 深圳市南山区高新南七道惠恒集团二期418室                                  |
| 法定代表人:  | 齐小贺  |
| 联系人:    | 陈勇军  |
| 电话:     | 0755-83999907  |
| 传真:     | 0755-83999926  |
| 客户服务电话: | 0755-83999913  |
| 网址:     | <a href="http://www.jinqianwo.cn">www.jinqianwo.cn</a> |

**(10) 上海陆金所基金销售有限公司**

|         |                                |
|---------|--------------------------------|
| 注册地址:   | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元 |
| 办公地址:   | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼       |
| 法定代表人:  | 郭坚                             |
| 联系人:    | 宁博宇                            |
| 电话:     | 021-20665952                   |
| 传真:     | 021-22066653                   |
| 客户服务电话: | 400-821-9031                   |
| 网址:     | www.lufunds.com                |

**(11) 珠海盈米财富管理有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491               |
| 办公地址:   | 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203 |
| 法定代表人:  | 肖雯                                      |
| 联系人:    | 吴煜浩                                     |
| 电话:     | 020-89629099                            |
| 传真:     | 020-89629011                            |
| 客户服务电话: | 020-80629066                            |
| 网址:     | www.yingmi.cn                           |

**(12) 深圳市金斧子基金销售有限公司**

|         |                               |
|---------|-------------------------------|
| 注册地址:   | 深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼 |
| 办公地址:   | 深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼  |
| 法定代表人:  | 赖任军                           |
| 联系人:    | 张烨                            |
| 电话:     | 0755-66892301                 |
| 传真:     | 0755-66892399                 |
| 客户服务电话: | 400-950-0888                  |
| 网址:     | www.jfzinv.com                |

**(13) 北京蛋卷基金销售有限公司**

|         |  |
|---------|--|
| 注册地址:   | 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507 |
| 办公地址:   | 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507 |
| 法定代表人:  | 钟斐斐                                    |
| 联系人:    | 戚晓强                                    |
| 电话:     | 15810005516                            |
| 传真:     | 010-85659484                           |
| 客户服务电话: | 400-061-8518                           |
| 网址:     | danjuanapp.com                         |

基金销售机构的具体名单见基金份额发售公告，基金管理人可依据实际情况增减、变更基金销售机构，并及时公告。

**二、登记机构**

名称：博时基金管理有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

办公地址：北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

法定代表人：张光华

电话：010-65171166

传真：010-65187068

联系人：许鹏

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：021- 51150298

传真：021- 51150398

联系人：刘佳

经办律师：廖海、刘佳

### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：林佳璐

经办注册会计师：张振波、林佳璐

## 四、基金的名称

博时广利纯债债券型证券投资基金

## 五、基金的类型

债券型

## 六、基金运作方式

本基金运作方式为契约型开放式，存续期间为不定期。



## 七、基金的投资目标

本基金在控制组合净值波动率的前提下，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。

## 八、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

## 九、基金的投资策略

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相补充的方法，确定资产在非信用类固定收益类证券和信用类固定收益类证券之间的配置比例。充分发挥基金管理人长期积累的信用研究成果，利用自主开发的信用分析系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，以获取最大化的信用溢价。本基金采用的投资策略包括：期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略等。在谨慎投资的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

在以上战略性资产配置的基础上，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，进行前瞻性的决策。一方面，本基金将分析众多的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等），并关注国家财政、税收、货币、汇率政策和其它证券市场政策等。另一方面，本基金将对债券市场整体收益率曲线变化进行深入细致分析，从而对市场走势和波动特征进行判断。在此基础上，确定资产在非信用类固定收益类证券（现金、国家债券、中央银行票据等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例。

灵活应用各种期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略，在合理管理并控制组合风险的前提下，最大化组合收益。

1、期限结构策略。通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类型债券进行久期配置；当收益率曲线走势难以判断时，参考基准指数的样本券久期构建组合久期，确保组合收益超过基准收益。具体来看，又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

1) 骑乘策略是当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。

2) 子弹策略是使投资组合中债券久期集中于收益率曲线的一点，适用于收益率曲线较陡时；杠铃策略是使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端，适用于收益率曲线两头下降较中间下降更多的蝶式变动；梯式策略是使投资组合中的债券久期均匀分布于收益率曲线，适用于收益率曲线水平移动。

2、信用策略。信用债收益率等于基准收益率加信用利差，信用利差收益主要受两个方面的影响，一是该信用债对应信用水平的市场平均信用利差曲线走势；二是该信用债本身的信用变化。基于这两方面的因素，我们分别采用以下的分析策略：

1) 基于信用利差曲线变化策略：一是分析经济周期和相关市场变化对信用利差曲线的影响，二是分析信用债市场容量、结构、流动性等变化趋势对信用利差曲线的影响，最后综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的及分行业投资比例。

2) 基于信用债信用变化策略：发行人信用发生变化后，我们将采用变化后债券信用级别所对应的信用利差曲线对公司债、企业债定价。影响信用债信用风险的因素分为行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险等五个方面。我们主要依靠内部评级系统分析信用债的相对信用水平、违约风险及理论信用利差。

3、互换策略。不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面存在差别，投资管理人可以同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种，赚取收益级差。

4、息差策略。通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，从而获得杠杆放大收益。

5、个券挖掘策略。本部分策略强调公司价值挖掘的重要性，在行业周期特征、公司基本面风险特征基础上制定绝对收益率目标策略，甄别具有估值优势、基本面改善的公司，采取高度分散策略，重点布局优势债券，争取提高组合超额收益空间。

#### 6、资产支持证券投资策略

本基金将通过对资产支持证券基础资产及结构设计的研究，结合多种定价模型，根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。

#### 7、中小企业私募债券投资策略

针对中小企业私募债券，本基金以持有到期，获得本金和票息收入为主要投资策略，

同时，密切关注债券的信用风险变化，力争在控制风险的前提下，获得较高收益。本基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

## 十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债综合财富(总值)指数收益率×90%+1年期定期存款利率(税后)×10%

本基金选择上述业绩比较基准的原因为本基金是通过债券等固定收益资产来获取的收益，力争获取相对稳健的绝对回报，追求委托财产的保值增值。

若未来法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时、或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整或变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

## 十一、基金的风险收益特征

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，属于中低预期风险/收益的产品。

## 十二、基金投资组合报告

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。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的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。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 12 月 31 日。本报告财务数据未经审计师审计。

### 12.1 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  | 固定收益投资 | 687,770,000.00 | 96.81        |

|   |                       |                |        |
|---|-----------------------|----------------|--------|
|   | 其中：债券                 | 687,770,000.00 | 96.81  |
|   | 资产支持证券                | -              | -      |
| 3 | 贵金属投资                 | -              | -      |
| 4 | 金融衍生品投资               | -              | -      |
| 5 | 买入返售金融资产              | 2,000,000.00   | 0.28   |
|   | 其中：买断式回购的<br>买入返售金融资产 | -              | -      |
| 6 | 银行存款和结算备付<br>金合计      | 4,414,573.36   | 0.62   |
| 7 | 其他各项资产                | 16,278,197.23  | 2.29   |
| 8 | 合计                    | 710,462,770.59 | 100.00 |

## 12.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 12.2.1 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股票。

### 12.2.2 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股票。

## 12.3 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。

## 12.4 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      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 79,712,000.00  | 11.23        |
|    | 其中：政策性金融债 | 49,934,000.00  | 7.03         |
| 4  | 企业债券      | 87,068,000.00  | 12.26        |
| 5  | 企业短期融资券   | 336,059,000.00 | 47.33        |
| 6  | 中期票据      | 184,931,000.00 | 26.05        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 687,770,000.00 | 96.87        |

## 12.5 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<br>值比例(%) |
|----|-----------|------------------|---------|---------------|------------------|
| 1  | 041772001 | 17 北京桑德<br>CP001 | 400,000 | 40,336,000.00 | 5.68             |

|   |           |                   |         |               |      |
|---|-----------|-------------------|---------|---------------|------|
| 2 | 101666003 | 16 华谊兄弟<br>MTN001 | 400,000 | 39,536,000.00 | 5.57 |
| 3 | 1780123   | 17 郑通航债<br>01     | 400,000 | 39,468,000.00 | 5.56 |
| 4 | 101654094 | 16 六合经开<br>MTN001 | 400,000 | 38,392,000.00 | 5.41 |
| 5 | 041758020 | 17 渤海金控<br>CP001  | 300,000 | 30,183,000.00 | 4.25 |

## 12.6 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。

## 12.7 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。

## 12.8 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。

## 12.9 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。

## 12.10 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。

## 12.11 投资组合报告附注

**12.11.1** 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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。

**12.11.2** 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。

### 12.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 3,598.47      |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 16,274,598.76 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |

|   |    |               |
|---|----|---------------|
| 8 | 其他 | -             |
| 9 | 合计 | 16,278,197.23 |

#### 12.11.4 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。

#### 12.11.5 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。

#### 12.11.6 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。

## 十三、基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

自基金合同生效开始，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

| 期间                       | 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    |
|--------------------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 2017.2.16-<br>2017.12.31 | 3.28%  | 0.03%     | 0.95%      | 0.05%         | 2.33% | -0.02% |

## 十四、基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式在次月前三个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前三个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。



### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于2017年9月30日刊登的本基金原招募说明书（《博时广利纯债债券型证券投资基金招募说明书》）进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要补充和更新的内容如下：

- 1、在“三、基金管理人”中，对基金管理人的基本情况进行了更新；
- 2、在“四、基金托管人”中，对基金托管人的基本情况进行了更新；
- 3、在“五、相关服务机构”中，更新了相关服务机构的内容，各新增代销机构均在指定媒体上公告列示；
- 4、在“八、基金的投资”中，更新了“（九）基金投资组合报告”的内容，数据内容截止时间为2017年12月31日；
- 5、在“九、基金的业绩”中，更新了基金业绩的内容，数据内容截止时间为2017年12月31日；
- 6、在“二十一、其它应披露的事项”中根据最新情况对相关应披露事项进行了更新：
  - （一）、2018年2月3日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时广利纯债债券型证券投资基金分红公告》；
  - （二）、2018年1月20日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时广利纯债债券型证券投资基金2017年第4季度报告》；

（三）、2017年12月20日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时广利纯债债券型证券投资基金分红公告》；

（四）、2017年10月27日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时广利纯债债券型证券投资基金2017年第3季度报告》；

（五）、2017年9月30日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时广利纯债债券型证券投资基金更新招募说明书2017年第1号（摘要）》；

（六）、2017年9月21日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时广利纯债债券型证券投资基金分红公告》；

（七）、2017年8月24日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时广利纯债债券型证券投资基金2017年半年度报告（摘要）》、

博时基金管理有限公司

2018年4月2日