

博时富融纯债债券型证券投资基金  
2019 年半年度报告  
2019 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：徽商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十七日

## § 1 重要提示及目录

---

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人徽商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 29 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况 .....	4
2.2 基金产品说明 .....	4
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	4
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	5
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>6</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	14
6.4 报表附注 .....	14
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>30</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	30
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	31
7.3 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	31
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	31
7.5 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 .....	31
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	32
7.7 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 .....	32
7.8 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 .....	32
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	32
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	32
7.11 投资组合报告附注 .....	32
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>33</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	33
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	33
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	33
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>33</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>34</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	34

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	34
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	34
10.4 基金投资策略的改变 .....	34
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	34
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	34
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	34
10.8 其他重大事件 .....	35
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>35</b>
11.1 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 .....	35
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	36
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>36</b>
12.1 备查文件目录 .....	36
12.2 存放地点 .....	36
12.3 查阅方式 .....	36

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时富融纯债债券型证券投资基金
基金简称	博时富融纯债债券
基金主代码	006929
交易代码	006929
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 1 月 29 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	徽商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,056,579,698.74 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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	<p>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。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。</p> <p>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，确定资产在固定收益类证券之间的配置比例。</p> <p>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，在合理管理并控制组合风险的前提下，最大化组合收益。</p>
业绩比较基准	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%。
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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	徽商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	刘国君
	联系电话	0755-83169999	0551-65970489
	电子邮箱	service@bosera.com	liuguojun@hsbank.com.cn
客户服务电话		95105568	4008896588
传真		0755-83195140	0551-65970481
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	安徽省合肥市安庆路79号

办公地址	广东省深圳市福田区益田路 5999号基金大厦21层	安徽省合肥市安庆路79号
邮政编码	518040	230006
法定代表人	张光华	吴学民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2019年1月29日（基金合同生效日）至 2019年6月30日）
本期已实现收益	24,298,460.28
本期利润	23,167,333.23
加权平均基金份额本期利润	0.0100
本期加权平均净值利润率	0.99%
本期基金份额净值增长率	1.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	22,607,852.93
期末可供分配基金份额利润	0.0110
期末基金资产净值	2,079,187,551.67
期末基金份额净值	1.0110
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	1.10%

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。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

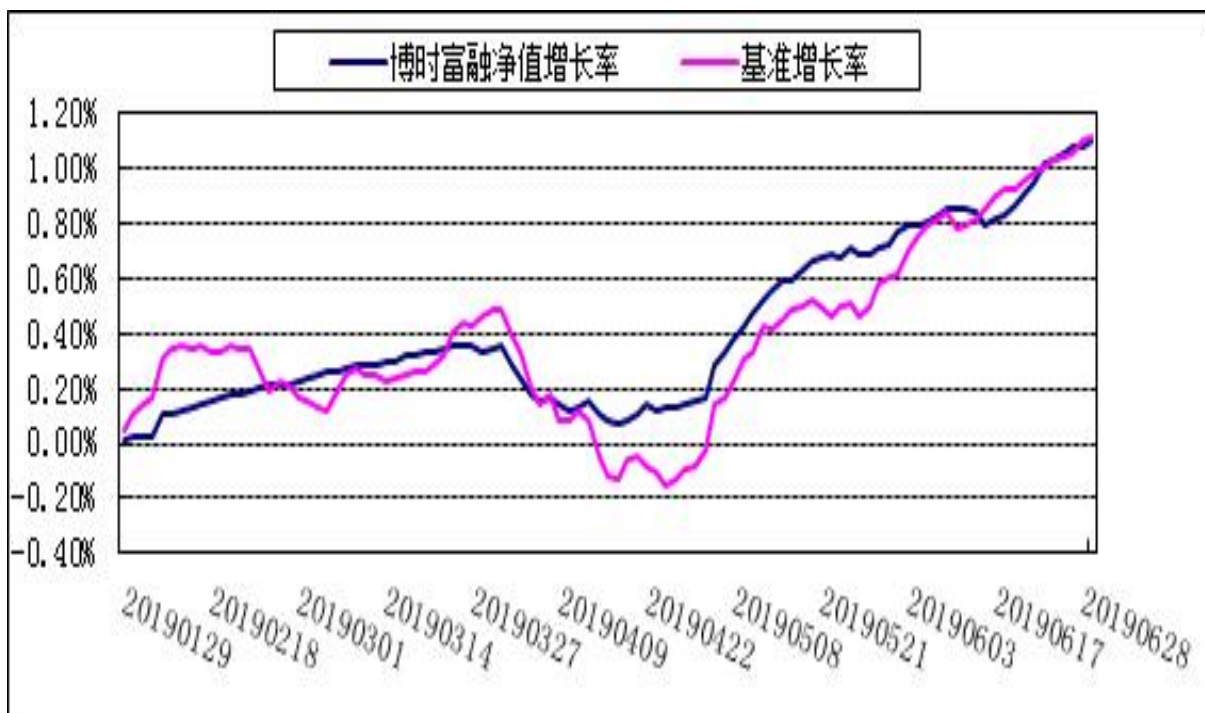
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.33%	0.02%	0.49%	0.03%	-0.16%	-0.01%

过去三个月	0.74%	0.03%	0.62%	0.05%	0.12%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.10%	0.03%	1.11%	0.05%	-0.01%	-0.02%

注：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%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 90%、10%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

### 3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额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



注：本基金的基金合同于 2019 年 1 月 29 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六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条“（二）投资范围”、“（四）投资限制”的有关约定。截止报告期末基金尚未完成建仓。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 2019 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 185 只开放式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户，管理资产总规模逾 9345 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 2699 亿元人民币，累计分红逾 980 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

#### 1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2019 年 2 季末：



博时旗下权益类基金业绩亮眼，54 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）今年来净值增长率银河同类排名在前 1/2，31 只银河同类排名在前 1/4，15 只银河同类排名在前 1/10，15 只银河同类排名在前 10。其中，博时回报灵活配置混合、博时乐臻定期开放混合、博时医疗保健行业混合今年来净值增长率分别在 145 只、61 只、14 只同类产品中排名第 1；博时量化平衡混合、博时弘泰定期开放混合、博时上证 50ETF 联接(A 类)、博时上证 50ETF 联接(C 类)、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(C 类) 今年来净值增长率分别在 102 只、61 只、46 只、34 只、15 只同类产品中排名第 3；博时特许价值混合(A 类) 今年来净值增长率在 414 只同类产品中排名第 20；博时鑫源灵活配置混合(C 类)、博时鑫源灵活配置混合(A 类)、博时上证 50ETF、博时新起点灵活配置混合(A 类)、博时颐泰混合(C 类)、博时睿利事件驱动灵活配置混合(LOF) 等基金今年来净值增长率排名在银河同类前 1/10；博时颐泰混合(A 类)、博时新兴消费主题混合、博时鑫瑞灵活配置混合(C 类)、博时新起点灵活配置混合(C 类)、博时鑫泽灵活配置混合(C 类)、博时文体娱乐主题混合、博时新兴成长混合、博时鑫瑞灵活配置混合(A 类)、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(A 类)、博时创新驱动灵活配置混合(C 类)、博时鑫泽灵活配置混合(A 类)、博时裕益灵活配置混合、博时沪港深优质企业灵活配置混合(A 类)、博时沪港深优质企业灵活配置混合(C 类) 等基金今年来净值增长率排名在银河同类前 1/4。

博时固定收益类基金业绩表现稳健，58 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）今年来净值增长率银河同类排名前 1/2，29 只银河同类排名在前 1/4，16 只银河同类排名在前 1/10，10 只银河同类排名在前 10。债券型基金中，博时转债增强债券(A 类)、博时转债增强债券(C 类) 今年来净值增长率分别在 28 只、15 只同类产品中排名第 1，且分别在全市场参与业绩排名的 1928 只债券基金中排名第 3、第 4；博时安盈债券(A 类)、博时安盈债券(C 类) 今年来净值增长率分别在同类产品中排第 2、第 3；博时安弘一年定期开放债券(A 类)、博时安康 18 个月定期开放债券(LOF)、博时安心收益定期开放债券(A 类)、博时岁岁增利一年定期开放债券、博时月月薪定期支付债券今年来净值增长率分别在 239 只同类产品中排名第 3、第 7、第 14、第 18、第 23；博时裕泰纯债债券、博时裕顺纯债债券、博时富瑞纯债债券、博时富祥纯债债券、博时裕腾纯债债券今年来净值增长率分别在 352 只同类产品中排名第 6、第 11、第 12、第 26、第 28；博时安弘一年定期开放债券(C 类) 今年来净值增长率在 58 只同类产品中排名第 3；博时信用债券(A/B 类)、博时信用债券(C 类) 今年来净值增长率在 228 只、163 只同类产品中均排名第 11；博时富兴纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时裕瑞纯债债券、博时裕创纯债债券、博时双月薪定期支付债券、博时安心收益定期开放债券(C 类)、博时裕盛纯债债券、博时裕恒纯债债券、博时裕盈纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时裕安纯债债券、博时安丰 18 个月定期开放债券(A 类-LOF) 等基金今年来净值增长率排名在银河同类前 1/4。货币型基金中，博时合惠货币(B 类) 今年来净值增长率在 296 只同类产品中排名第 8，博时合惠货币(A 类)、博时现金宝货币(B 类)、博时现金宝货币(A 类) 等基金今年来净值增长率排名在银河同类前 1/4。

商品型基金当中，博时黄金 ETF 今年来净值增长率同类排名第 3。

QDII 基金方面，博时标普 500ETF 今年来净值增长率同类排名第 2、博时亚洲票息收益债券、博时亚洲票息收益债券(美元) 今年来净值增长率均在同类排名第 7。

## 2、其他大事件



2019 年 6 月 20 日，由中国基金报独家主办的第六届中国基金业“英华奖”评选隆重揭晓，博时基金在此次英华奖中揽获 6 项最佳基金经理大奖。其中，博时基金蔡滨拿下“三年期股票投资最佳基金经理”；陈凯杨荣膺“五年期纯债投资最佳基金经理”；何凯则一举揽获“三年期海外固收投资最佳基金经理”和“五年期海外固收投资最佳基金经理”两项桂冠；过钧则再度获得“三年期二级债投资最佳基金经理”和“五年期二级债投资最佳基金经理”称号。

2019 年 4 月 25 日，由上海证券报主办的第十六届“金基金”奖的评选结果如期揭晓，博时基金在评选中一举夺得最具份量的公司奖项“2018 年度金基金•TOP 公司奖”，博时主题行业（160505）继去年获得“三年期金基金分红奖”后拿下“2018 年度金基金•十年期偏股混合型基金奖”，同时，博时裕瑞纯债债券（001578）获得“2018 年度金基金•一年期债券基金奖”。

2019 年 4 月 14 日，第十六届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，博时基金旗下绩优产品博时主题行业混合（LOF）（160505）荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖；博时信用债纯债债券（050027）荣获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2019 年 3 月 21 日，由证券时报主办的第六届中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛在北京隆重举行，同时第十四届中国基金业明星基金奖和中国公募基金首届英华奖也随之揭晓。博时基金凭借出色的资产管理能力和优秀的业绩表现，一举摘得“2018 年度十大明星基金公司”称号。在英华奖的评选中，博时基金在获评“2018 年度最佳电商业务发展基金公司”奖的同时，还凭借博时基金 20 周年品牌传播项目拿下了“2018 年度最佳营销策划案例（最佳综合）”奖。此外，博时慈善基金会公益助学项目获得了“2018 年度最佳社会公益实践案例”。在产品奖方面，助力央企结构转型和改革的博时央企结构调整 ETF 获评英华奖“2018 年度最佳创新基金产品”；博时裕瑞纯债债券获得“2018 年度普通债券型明星基金”奖；博时宏观回报债券则凭借同类可比基金第一的佳绩喜获“2018 年度积极债券型明星基金”奖；博时亚洲票息收益债券（QDII）、博时双月薪定期支付债券双双以过去五年稳居同类前列的好成绩分别拿下“五年持续回报 QDII 明星基金”、“五年持续回报普通债券型明星基金”称号；博时裕恒纯债债券则摘得“三年期持续回报普通债券型明星基金”。

2019 年 2 月 25 日，博时国际在“投资洞见与委托”（Insights&Mandate）举办的第二届专业投资奖评选活动中荣获“2019 年度最佳机构法人投资经理”，并凭借博时国际于 2018 年 5 月 10 日共同成立的“博时—东方红大中华债券基金”获“最佳创新产品”大奖。

2019 年 1 月 23 日，由深圳市福田区金融发展事务署首届举办的“香蜜湖金融科技创新奖”颁奖典礼在深圳福田隆重举行，《博时基金基于大数据技术升级量化投资技术》项目荣获优秀项目奖，博时基金采用金融科技为业务赋能的创新成果获得行业和地方政府高度认可。

2019 年 1 月 11 日，中央国债登记结算有限责任公司（以下简称“中债登”）公布了《2018 年度中债优秀成员评选结果》。凭借在债券市场上的深厚积淀和优异的投研业绩，博时基金获评年度“优秀资产管理人”称号，全行业获此殊荣的基金公司仅有 10 家。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

		任职日期	离任日期		
陈黎	基金经理	2019-01-29	-	5.0	陈黎女士，硕士。2014 年从上海财经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、高级研究员兼基金经理助理。现任博时安怡 6 个月定期开放债券型证券投资基金(2018 年 4 月 9 日一至今)、博时慧选纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 8 月 9 日一至今)、博时富祥纯债债券型证券投资基金(2018 年 10 月 29 日一至今)、博时裕安纯债债券型证券投资基金(2019 年 1 月 16 日一至今)、博时富融纯债债券型证券投资基金(2019 年 1 月 29 日一至今)、博时景发纯债债券型证券投资基金(2019 年 2 月 25 日一至今)、博时聚盈纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日一至今)、博时裕利纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日一至今)、博时聚润纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日一至今)、博时富源纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日一至今)、博时裕达纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 11 日一至今)、博时裕丰纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2019 年 3 月 11 日一至今)、博时裕康纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 11 日一至今)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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，债券市场宽幅震荡，收益率低位筑底。一季度，先是在央行宽松货币政策影响下，收益率快速下行至本轮牛市低点，而后在社融企稳、权益市场强势的影响下，震荡向上；进入4月，由于一季度经济数据超预期强势，市场对基本面悲观预期显著修复；同时政治局会议定调结构性去杠杆，重提“总闸门”、“不搞大水漫灌”，货币政策边际转紧，10年国开收益率在4月下旬上行至本轮调整的高点3.9%。而后，随着中美贸易谈判出现波折，基本面数据明显回落，货币政策相机抉择下偏宽松，市场流动性充裕，收益率自5月起重拾下行。从指数看，中债总财富指数上涨1.49%，中债国债总财富指数上涨1.04%，中债企业债总财富指数上涨了3.2%，中债短融总财富指数上涨了1.9%。

上半年，本基金基于对市场中性预期，保持中低久期和适度杠杆的操作。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年06月30日，本基金基金份额净值为1.0110元，份额累计净值为1.0110元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为1.10%，同期业绩基准增长率1.11%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市：下半年债券收益率可能延续大幅波动的特点。一方面，国内外经济基本面均有继续下行压力，全球央行陆续进入降息区间，中美贸易冲突不确定性仍然较强，支撑债券收益率下行。另一方面，经济压力下的政策逆周期调控、通胀预期升温、金融机构去杠杆带来的潜在流动性风险都是下半年债券市场的潜在风险因素，使得债券收益率波动可能较大。同时伴随部分金融机构去杠杆，实体企业再融资也将受到一定影响，对资质较低的中低评级信用债风险需保持谨慎。整体来看，下半年债券投资仍需以票息为基础，在波动环境下把握交易性机会，重视回撤控制。

本组合在投资思路上保持谨慎乐观，维持中高评级中等久期信用债配置，在流动性较为宽松的环境下，合理利用杠杆，适度增加信用债配置，提高票息保护，同时灵活把握市场机会获取利率债波段操作收益。精选个券严控信用风险，积极应对利率波动，合理控制组合回撤。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有5年以上专业工作经历，具备良好的专

业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

---

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

---

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：博时富融纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		-
银行存款	6.4.7.1	3,044,738.31
结算备付金		8,125,938.51
存出保证金		103,325.94
交易性金融资产	6.4.7.2	2,772,890,700.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		2,496,786,200.00
资产支持证券投资		276,104,500.00
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		5,098,974.47
应收利息	6.4.7.5	41,841,325.84
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
<b>资产总计</b>		<b>2,831,105,003.07</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>
<b>负 债：</b>		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款	6.4.7.3	745,304,645.69
应付证券清算款		5,085,959.61
应付赎回款		10.10
应付管理人报酬		511,601.12
应付托管费		170,533.71
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	32,728.78
应交税费		235,560.62
应付利息		537,654.32
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	38,757.45
<b>负债合计</b>		<b>751,917,451.40</b>
<b>所有者权益：</b>		-
实收基金	6.4.7.9	2,056,579,698.74
未分配利润	6.4.7.10	22,607,852.93
<b>所有者权益合计</b>		<b>2,079,187,551.67</b>

负债和所有者权益总计		<b>2,831,105,003.07</b>
------------	--	-------------------------

注：1. 报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,056,579,698.74 份，基金份额净值 1.0110 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：博时富融纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>28,599,911.39</b>
1. 利息收入		33,756,078.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,399,027.19
债券利息收入		21,639,658.78
资产支持证券利息收入		1,618,557.75
买入返售金融资产收入		2,098,834.93
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,025,211.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-4,025,211.92
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,131,127.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	171.71
<b>减：二、费用</b>		<b>5,432,578.16</b>
1. 管理人报酬		2,820,761.98
2. 托管费		940,254.00
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	22,723.80
5. 利息支出		1,537,376.48
其中：卖出回购金融资产支出		1,537,376.48
6. 税金及附加		70,804.45
7. 其他费用	6.4.7.19	40,657.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>23,167,333.23</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>23,167,333.23</b>



### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时富融纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	210,003,397.82	-	210,003,397.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,167,333.23	23,167,333.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,846,576,300.92	-559,480.30	1,846,016,820.62
其中：1. 基金申购款	3,993,106,762.76	6,987,992.52	4,000,094,755.28
2. 基金赎回款	-2,146,530,461.84	-7,547,472.82	-2,154,077,934.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,056,579,698.74	22,607,852.93	2,079,187,551.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳

主管会计工作负责人：王德英

会计机构负责人：成江

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

博时富融纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]第 2077 号《关于准予博时富融纯债债券型证券投资基金募集的批复》核准,由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时富融纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 210,003,397.76 元,业经普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道(2019)验字第 0089 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博时富融纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2019 年 1 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 210,003,397.82 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司,基金托管人为徽商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时富融纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关



规定，本基金的投资范围主要包括国债、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、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等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）。本基金不投资于股票、权证等资产，也不投资于可转换债券、可交换债券。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投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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%。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2019 年 8 月 27 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时富融纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观

察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现

部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充

通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日	
	活期存款	3,044,738.31
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	3,044,738.31	

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	451,408,106.01	-967,906.01
	银行间市场	2,045,963,735.29	382,264.71
	合计	2,497,371,841.30	-585,641.30
资产支持证券	276,649,985.75	276,104,500.00	-545,485.75
基金	-	-	-



其他	-	-	-
合计	2,774,021,827.05	2,772,890,700.00	-1,131,127.05

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	1,659.34
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,656.70
应收债券利息	38,121,146.63
应收资产支持证券利息	3,714,816.67
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	46.50
合计	41,841,325.84

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	32,728.78
合计	32,728.78

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
其他应付款	-
预提费用	38,757.45
合计	38,757.45

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日
----	--------------------------------------

	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	210,003,397.82	210,003,397.82
本期申购	3,993,106,762.76	3,993,106,762.76
本期赎回 (以“-”号填列)	-2,146,530,461.84	-2,146,530,461.84
本期末	2,056,579,698.74	2,056,579,698.74

注: 1. 申购含红利再投、转换入份额, 赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2019 年 1 月 21 日至 2019 年 1 月 28 日止期间公开发售, 共募集有效净认购资金人民币 210,003,397.76 元, 折合为 210,003,397.76 份基金份额。根据《博时富融纯债债券型证券投资基金招募说明书》的规定, 本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 0.06 元在本基金成立后, 折算为 0.06 份基金份额, 划入基金份额持有人账户。

3. 根据《博时富融纯债债券型证券投资基金基金合同》、《博时富融纯债债券型证券投资基金招募说明书》及《博时富融纯债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》的相关规定, 本基金于 2019 年 1 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 2 月 17 日止期间暂不向投资人开放基金交易。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位: 人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	24,298,460.28	-1,131,127.05	23,167,333.23
本期基金份额交易产生的变动数	-712,117.88	152,637.58	-559,480.30
其中: 基金申购款	6,988,002.79	-10.27	6,987,992.52
基金赎回款	-7,700,120.67	152,647.85	-7,547,472.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,586,342.40	-978,489.47	22,607,852.93

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	509,835.04
定期存款利息收入	7,862,500.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	26,370.47
其他	321.68
合计	8,399,027.19

#### 6.4.7.12 股票投资收益

无发生额。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日
卖出债券 (债转股及债券到期兑付) 成交总额	985,641,364.57
减: 卖出债券 (债转股及债券到期兑付) 成本总额	960,751,780.66
减: 应收利息总额	28,914,795.83
买卖债券差价收入	-4,025,211.92



**6.4.7.14 衍生工具收益**

无发生额。

**6.4.7.15 股利收益**

无发生额。

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,131,127.05
——股票投资	-
——债券投资	-585,641.30
——资产支持证券投资	-545,485.75
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-1,131,127.05

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日
基金赎回费收入	5.04
其他	166.67
合计	171.71

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日
交易所市场交易费用	1,098.80
银行间市场交易费用	21,625.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	22,723.80

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日
审计费用	18,159.57
信息披露费	11,297.88
中债登账户维护费	6,000.00

上清所账户维护费	4,800.00
其他	400.00
合计	40,657.45

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、基金销售机构
徽商银行股份有限公司（“徽商银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	493,201,284.91	100.00%

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	6,524,143,000.00	100.00%

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
当期发生的基金应支付的管理费	2,820,761.98	
其中：支付销售机构的客户维护费	8.64	

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	940,254.00	

注：支付基金托管人徽商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
徽商银行	3,044,738.31	509,835.04

注：本基金的活期银行存款由基金托管人徽商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别-债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

139765	信捷 13 优	2019- 06-24	2019- 07-24	未上市	100.00	100.00	200,000.00	20,000,000.00	20,000,000.00	-
--------	------------	----------------	----------------	-----	--------	--------	------------	---------------	---------------	---

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 476,204,645.69 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
180209	18 国开 09	2019-07-01	100.03	1,053,000.00	105,331,590.00
041900128	19 江阴城投 CP001	2019-07-04	100.06	600,000.00	60,036,000.00
011900116	19 大同煤矿 SCP002	2019-07-01	100.45	500,000.00	50,225,000.00
101800177	18 萧山钱江 MTN001	2019-07-04	103.58	400,000.00	41,432,000.00
101800630	18 江北建投 MTN001	2019-07-01	102.83	400,000.00	41,132,000.00
101800820	18 良渚文化 MTN001	2019-07-04	102.42	400,000.00	40,968,000.00
101800412	18 晋江城投 MTN002	2019-07-04	102.31	400,000.00	40,924,000.00
011900839	19 威海国资 SCP002	2019-07-04	100.08	315,000.00	31,525,200.00
101900438	19 鲁黄金 MTN002	2019-07-01	100.39	300,000.00	30,117,000.00
011901354	19 大同煤矿 SCP014	2019-07-01	100.20	300,000.00	30,060,000.00
111998791	19 富滇银行 CD119	2019-07-02	96.26	230,000.00	22,139,800.00
101900732	19 晋江城投 MTN003	2019-07-01	99.99	73,000.00	7,299,270.00
合计				4,971,000.00	501,189,860.00

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 269,100,000.00 元，于 2019 年 07 月 11 日(先后)到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中

面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；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与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行徽商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日
A-1	100,064,000.00
A-1 以下	-
未评级	490,772,000.00
合计	590,836,000.00

注：未评级为短期融资券、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	40,002,000.00
合计	40,002,000.00

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	183,734,000.00
合计	183,734,000.00

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日
AAA	964,548,200.00
AAA 以下	757,668,000.00
未评级	-
合计	1,722,216,200.00

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日
AAA	236,102,500.00
AAA 以下	-
未评级	-
合计	236,102,500.00

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。



于 2019 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 745,304,645.69 元将在 1 个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2019 年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融



工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	3,044,738.31	-	-	-	3,044,738.31
结算备付金	8,125,938.51	-	-	-	8,125,938.51
存出保证金	103,325.94	-	-	-	103,325.94
交易性金融资产	1,080,154,500.00	1,692,736,200.00	-	-	2,772,890,700.00
应收证券清算款	-	-	-	5,098,974.47	5,098,974.47
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	41,841,325.84	41,841,325.84
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>1,091,428,502.76</b>	<b>1,692,736,200.00</b>	<b>-</b>	<b>46,940,300.31</b>	<b>2,831,105,003.07</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	745,304,645.69	-	-	-	745,304,645.69
应付赎回款	-	-	-	10.10	10.10
应付证券清算款	-	-	-	5,085,959.61	5,085,959.61
应付管理人报酬	-	-	-	511,601.12	511,601.12
应付托管费	-	-	-	170,533.71	170,533.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	235,560.62	235,560.62
应付交易费用	-	-	-	32,728.78	32,728.78
应付利息	-	-	-	537,654.32	537,654.32
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	38,757.45	38,757.45
<b>负债总计</b>	<b>745,304,645.69</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>6,612,805.71</b>	<b>751,917,451.40</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>346,123,857.07</b>	<b>1,692,736,200.00</b>	<b>-</b>	<b>40,327,494.60</b>	<b>2,079,187,551.67</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）
		本期末 2019年6月30日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 939
	市场利率下降 25 个基点	增加约 945

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所

有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 2,772,890,700.00 元，无属于第一或第三层次的余额。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	2,772,890,700.00	97.94
	其中：债券	2,496,786,200.00	88.19
	资产支持证券	276,104,500.00	9.75
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	11,170,676.82	0.39
8	其他各项资产	47,043,626.25	1.66
9	合计	2,831,105,003.07	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

无。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	130,657,000.00	6.28
	其中：政策性金融债	110,033,000.00	5.29
4	企业债券	491,685,200.00	23.65
5	企业短期融资券	480,803,000.00	23.12
6	中期票据	1,209,907,000.00	58.19
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	183,734,000.00	8.84
9	其他	-	-
10	合计	2,496,786,200.00	120.08

## 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	180209	18 国开 09	1,100,000	110,033,000.00	5.29
2	111993002	19 杭州银行 CD036	1,000,000	96,960,000.00	4.66
3	143540	18 栖建 01	600,000	62,760,000.00	3.02
4	143658	18 金地 04	600,000	61,932,000.00	2.98
5	041900128	19 江阴城投 CP001	600,000	60,036,000.00	2.89

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	149939	18 借呗 2A	400,000.00	40,532,000.00	1.95
2	159293	时代 03 优	400,000.00	39,960,000.00	1.92
3	139607	苏宁 2A	370,000.00	37,051,800.00	1.78
4	139628	方碧 49 优	310,000.00	31,055,800.00	1.49
5	149879	18 借 03A1	300,000.00	30,390,000.00	1.46
6	159078	龙联 01A	270,000.00	26,991,900.00	1.30
7	139463	方碧 46 优	200,000.00	20,118,000.00	0.97
8	139682	信捷 12 优	200,000.00	20,002,000.00	0.96
9	139765	信捷 13 优	200,000.00	20,000,000.00	0.96
10	139656	方碧 50 优	100,000.00	10,003,000.00	0.48

### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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。

### 7.10 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。

### 7.11 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。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

7.12.2 本基金本报告期末未持有股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	103,325.94
2	应收证券清算款	5,098,974.47
3	应收股利	-
4	应收利息	41,841,325.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,043,626.25

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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。

#### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
249	8,259,356.22	2,056,503,122.77	100.00%	76,575.97	0.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,980.12	0.00%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：1. 本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人未持有本基金；  
2. 本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 1 月 29 日）基金份额总额	210,003,397.82
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,993,106,762.76
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,146,530,461.84
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,056,579,698.74

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
招商证券	2	-	-	-	-	新增 2 个

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司业务管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	493,201,284.91	100.00%	6,524,143,000.00	100.00%	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时富融纯债债券型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证券时报	2019-04-22
2	关于博时旗下部分基金开通直销网上交易定期投资业务的公告	证券时报	2019-03-30
3	博时富融纯债债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证券时报	2019-03-02
4	博时富融纯债债券型证券投资基金开放日常转换、定期定额投资业务的公告	证券时报	2019-02-19
5	博时富融纯债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证券时报	2019-02-16
6	博时富融纯债债券型证券投资基金-基金合同生效公告	证券时报	2019-01-30
7	关于博时富融纯债债券型证券投资基金提前结束募集的公告	证券时报	2019-01-29
8	博时基金管理有限公司关于在直销网上交易开展博时富融纯债债券型证券投资基金认购费率优惠活动的公告	证券时报	2019-01-21
9	博时富融纯债债券型证券投资基金托管协议	证券时报	2019-01-18
10	博时富融纯债债券型证券投资基金招募说明书	证券时报	2019-01-18
11	博时富融纯债债券型证券投资基金基金合同	证券时报	2019-01-18
12	博时富融纯债债券型证券投资基金基金份额发售公告	证券时报	2019-01-18



## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019-01-29~2019-03-26	59,999,000.00	1,996,504,122.77	2,056,503,122.77	-	-
	2	2019-01-29~2019-06-30	59,999,000.00	1,996,504,122.77	-	2,056,503,122.77	100.00%

#### 产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时富融纯债债券型证券投资基金设立的文件

12.1.2 《博时富融纯债债券型证券投资基金基金合同》

12.1.3 《博时富融纯债债券型证券投资基金托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.1.5 报告期内博时富融纯债债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，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

二〇一九年八月二十七日