

# 博时聚润纯债债券型证券投资基金

## 2019 年年度报告

### 2019 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年三月二十七日

## §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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 月 25 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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                       | 1  |
| 1.1 重要提示 .....                                | 1  |
| 1.2 目录 .....                                  | 2  |
| <b>§2 基金简介</b> .....                          | 4  |
| 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、基金净值表现及利润分配情况</b> .....          | 5  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 5  |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 6  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....                       | 7  |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                         | 7  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                        | 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 .....              | 14 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 14 |
| 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 .....             | 15 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....             | 15 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....                 | 16 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                | 16 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 17 |
| 4.9 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 .....       | 17 |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                         | 17 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 17 |
| 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 ..... | 17 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....      | 18 |
| <b>§6 审计报告</b> .....                          | 18 |
| 6.1 审计意见 .....                                | 18 |
| 6.2 形成审计意见的基础 .....                           | 18 |
| 6.3 其他信息 .....                                | 18 |
| 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任 .....                     | 19 |
| 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任 .....                     | 19 |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                        | 20 |
| 7.1 资产负债表 .....                               | 20 |
| 7.2 利润表 .....                                 | 21 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                      | 22 |
| 7.4 报表附注 .....                                | 23 |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                        | 43 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 43 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....                      | 43 |
| 8.3 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 .....       | 43 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 44 |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 44        |
| 8.6 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 .....    | 44        |
| 8.7 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 ..... | 44        |
| 8.8 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 ..... | 45        |
| 8.9 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 .....    | 45        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 45        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 45        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 45        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>46</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 46        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 46        |
| 9.3 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 .....     | 46        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>46</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>46</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 46        |
| 11.2 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 .....      | 47        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 47        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 47        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 47        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 47        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 47        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 48        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>             | <b>49</b> |
| 12.1 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 .....    | 49        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 50        |
| <b>§13 备查文件目录 .....</b>                     | <b>50</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 50        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 50        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 50        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金名称       | 博时聚润纯债债券型证券投资基金  |
| 基金简称       | 博时聚润纯债债券         |
| 基金主代码      | 002930           |
| 交易代码       | 002930           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2016 年 8 月 30 日  |
| 基金管理人      | 博时基金管理有限公司       |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 999,263,796.83 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在一定程度上控制组合净值波动率的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。   |
| 投资策略   | 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。 |
| 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                        | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 孙麒清                               | 张燕                     |
|         | 联系电话 | 0755-83169999                     | 0755-83199084          |
|         | 电子邮箱 | service@bosera.com                | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话  |      | 95105568                          | 95555                  |
| 传真      |      | 0755-83195140                     | 0755-83195201          |
| 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 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦   |
| 办公地址    |      | 广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层      | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦   |

|       |        |        |
|-------|--------|--------|
| 邮政编码  | 518040 | 518040 |
| 法定代表人 | 张光华    | 李建红    |

## 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                    |
|--------|--------------------|-------------------------|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

### 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 | 2019 年           | 2018 年           | 2017 年           |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | 29,672,480.51    | 37,728,875.99    | 58,425,278.08    |
| 本期利润          | 27,798,926.99    | 39,422,770.50    | 65,275,454.67    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0278           | 0.0394           | 0.0336           |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.73%            | 3.87%            | 3.34%            |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.77%            | 3.95%            | 3.45%            |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2019 年末          | 2018 年末          | 2017 年末          |
| 期末可供分配利润      | 33,642,139.29    | 4,601,405.23     | 1,097,850.96     |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0337           | 0.0046           | 0.0011           |
| 期末基金资产净值      | 1,032,905,936.12 | 1,005,147,828.57 | 1,000,464,960.91 |
| 期末基金份额净值      | 1.0337           | 1.0058           | 1.0011           |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2019 年末          | 2018 年末          | 2017 年末          |
| 基金份额累计净值增长率   | 10.97%           | 7.97%            | 3.87%            |

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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 0.71%    | 0.01%       | 1.21%      | 0.04%         | -0.50% | -0.03% |
| 过去六个月      | 1.36%    | 0.01%       | 2.52%      | 0.04%         | -1.16% | -0.03% |
| 过去一年       | 2.77%    | 0.01%       | 4.28%      | 0.04%         | -1.51% | -0.03% |
| 过去三年       | 10.51%   | 0.02%       | 12.55%     | 0.06%         | -2.04% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.97%   | 0.02%       | 11.47%     | 0.06%         | -0.50% | -0.04% |

注：本基金业绩比较基准为：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%。

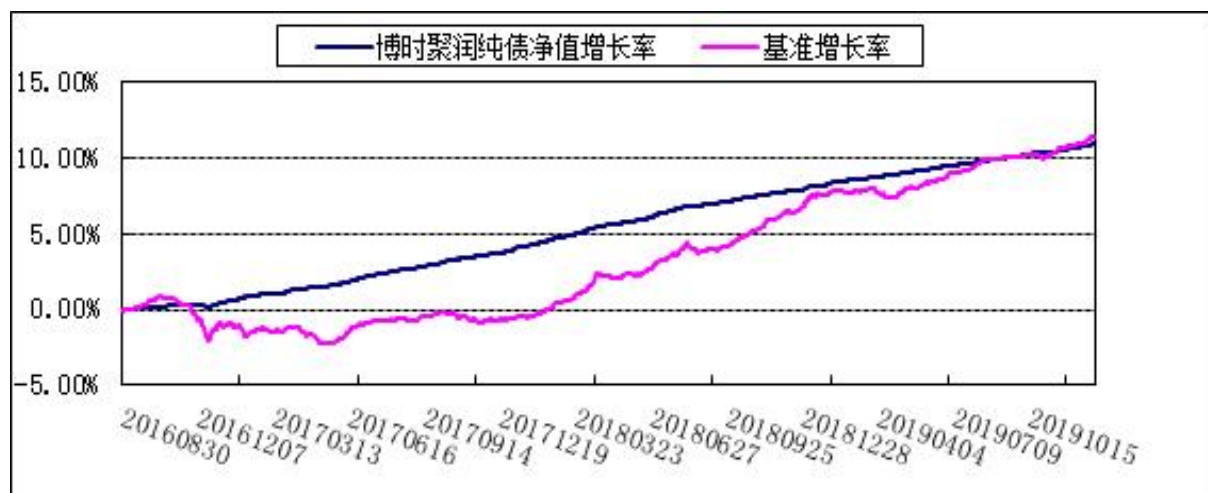
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 90%、10%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

#### 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

##### 博时聚润纯债债券型证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

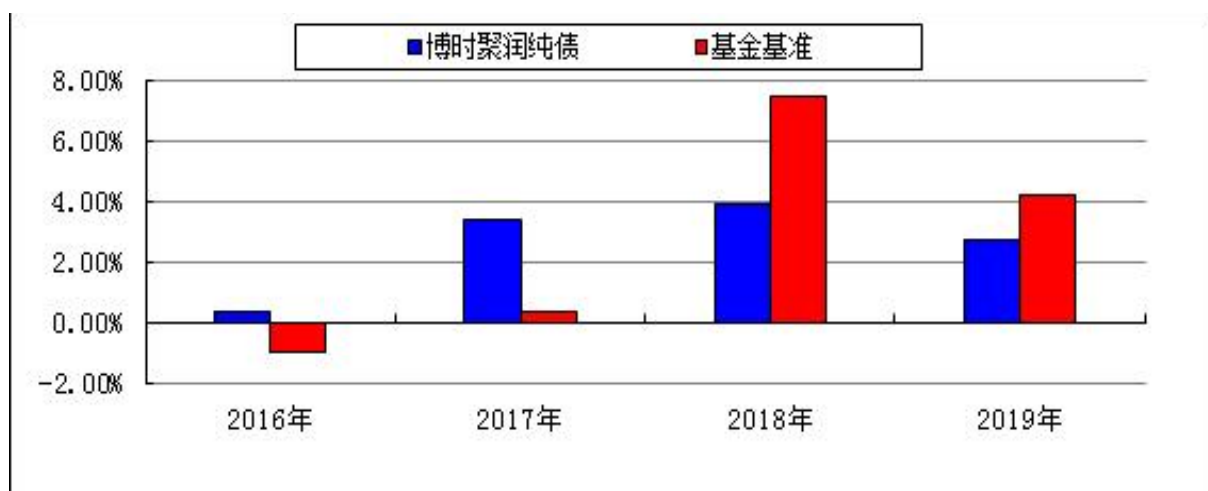
(2016 年 8 月 30 日至 2019 年 12 月 31 日)



#### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 博时聚润纯债债券型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金的基金合同于 2016 年 8 月 30 日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度     | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额       | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计       | 备注 |
|--------|---------------|----------------|-----------|----------------|----|
| 2019 年 | -             | -              | -         | -              | -  |
| 2018 年 | 0.347         | 34,674,775.29  | 1,965.37  | 34,676,740.66  | -  |
| 2017 年 | 0.371         | 72,842,504.32  | 611.16    | 72,843,115.48  | -  |
| 合计     | 0.718         | 107,517,279.61 | 2,576.53  | 107,519,856.14 | -  |

## §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，“做投资价值的发现者”是博时的理念。截至 2019 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 199 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、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 10668 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 3270 亿元人民币，累计分红逾 1206 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 4 季末：



博时旗下权益类基金业绩表现优异，70 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）2019 年净值增长率超过 30%，38 只产品净值增长率超过 40%，10 只产品净值增长率超过 60%，4 只产品净值增长率超过 80%，2 只产品净值增长率超过 90%；从相对排名来看，62 只产品 2019 年净值增长率银河证券同类排名在前 1/2，32 只产品同类排名在前 1/4，13 只产品同类排名在前 10，2 只产品同类排名第 1。

其中，博时回报混合、博时医疗保健混合 2019 年净值增长率均同类排名第 1，博时弘泰定期开放混合、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(C 类) 同类排名第 2，博时文体娱乐主题混合、博时丝路主题股票(C 类)、博时乐臻定期开放混合、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(A 类)、博时弘盈定期开放混合(C 类)、博时特许价值混合(A 类)、博时中证银联智慧大数据 100 指数(C 类)、博时量化平衡混合、博时中证淘金大数据 100 指数(I 类)同类排名分别为第 4、第 4、第 7、第 7、第 7、第 8、第 8、第 10、第 10，博时睿利事件驱动灵活配置混合(LOF)、博时鑫泽灵活配置混合(C 类)、博时裕益灵活配置混合同类排名均在前 1/10，博时鑫源灵活配置混合(C 类)、博时厚泽回报灵活配置混合(C 类)、博时互联网主题灵活配置混合、博时新兴消费主题混合、博时沪港深优质企业灵活配置混合(C 类)、博时鑫泽灵活配置混合(A 类)、博时鑫源灵活配置混合(A 类)、博时创新驱动灵活配置混合(C 类)、博时颐泰混合(A 类)、博时新起点灵活配置混合(C 类)、博时新兴成长混合、博时颐泰混合(C 类)、博时新起点灵活配置混合(A 类)、博时厚泽回报灵活配置混合(A 类)、博时鑫瑞灵活配置混合(C 类)、博时战略新兴产业混合、博时睿远事件驱动灵活配置混合(LOF)、博时沪港深优质企业灵活配置混合(A 类)、博时策略灵活配置混合等产品 2019 年来净值增长率同类排名均在前 1/4。此外，博时裕隆灵活配置混合、博时主题行业混合(LOF)、博时汇智回报灵活配置混合、博时外延增长主题灵活配置混合、博时产业新动力灵活配置混合(A 类)等产品不仅 2019 年业绩表现较好，成立以来年化回报亦可观，长期投资价值凸显。

博时固定收益类基金表现同样可圈可点，67 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）2019 年净值增长率超过 4%，19 只产品净值增长率超过 6%，8 只产品净值增长率超过 10%，2 只产品净值增长率超过 30%；从相对排名来看，68 只产品 2019 年净值增长率银河证券同类排名在前 1/2，40 只产品同类排名在前 1/4，18 只产品同类排名在前 1/10，6 只产品同类排名前 5，1 只产品同类排名第 1。

其中，博时安康 18 个月定期开放债券(LOF)2019 年净值增长率同类排名第 1，博时安盈债券(A 类)、博时安盈债券(C 类)、博时月月薪定期支付债券、博时转债增强债券(C 类)、博时安心收益定期开放债券(C 类)同类排名分别在第 2、第 3、第 4、第 4、第 5，博时富瑞纯债债券(A 类)、博时转债增强债券(A 类)、博时信用债券(C 类)、博时安心收益定期开放债券(A 类)、博时裕顺纯债债券、

博时合惠货币(B类)、博时信用债券(A/B类) 同类排名分别排在第6、第6、第7、第8、第9、第9、第9, 博时裕腾纯债债券、博时裕泰纯债债券、博时岁岁增利一年定期开放债券、博时裕创纯债债券、博时裕盈纯债3个月定期开放债券发起式、博时富祥纯债债券、博时富兴纯债3个月定期开放债券发起式、博时信用债纯债债券(A类)、博时信用债纯债债券(C类)同类排名均在前1/10, 博时稳健回报债券(LOF)(C类)、博时合惠货币(A类)、博时裕安纯债债券、博时稳健回报债券(LOF)(A类)、博时合鑫货币、博时聚瑞纯债6个月定期开放债券发起式、博时现金宝货币(B类)、博时现金宝货币(A类)、博时外服货币、博时富业纯债3个月定期开放债券发起式、博时安丰18个月定期开放债券(A类-LOF)、博时裕盛纯债债券、博时富腾纯债债券、博时天颐债券(A类)、博时宏观回报债券(A/B类)、博时安瑞18个月定期开放债券(A类)、博时天颐债券(C类)、博时安泰18个月定期开放债券(A类)、博时宏观回报债券(C类)、博时景兴纯债债券、博时裕达纯债债券等产品同类排名均在前1/4。

博时旗下 QDII 基金继续表现突出, 博时标普 500ETF、博时标普 500ETF 联接 (C 类)、博时标普 500ETF 联接 (A 类) 2019 年净值增长率分别超过或接近 30%, 同类排名分别为第 4、第 6、第 14; 博时亚洲票息收益债券 (人民币) 2019 年净值增长率超过 10%, 同类排名第 7。

商品型基金当中, 博时黄金 ETF、博时黄金 ETF 联接(A类)、博时黄金 ETF 联接(C类)2019 年均较好地跟上了黄金上涨行情, 净值增长率均超过 18%, 其中博时黄金 ETF 净值增长率同类排名第 3。

## 2、其他大事件

2019 年 12 月 26 日, 界面新闻在京举办“2019 中国优金融奖”颁奖盛典, 博时基金凭借“政策响应、行业领先、实体支持、创新赋能”等方面的综合卓越表现, 荣获“年度基金公司”大奖以及“2019 中国好品牌”。

2019 年 12 月 21 日, 和讯网“第十七届财经风云榜金融峰会”在上海举办, 博时基金荣获“年度卓越影响力基金公司”, 博时基金葛晨获“年度卓越公募基金经理”。

2019 年 12 月 20 日, 华夏时报“华夏机构投资者年会暨第十三届金蝉奖颁奖典礼”在北京举办。博时基金荣获“年度投研领先公募基金公司”。

2019 年 12 月 12 日, 投资者网“2019 中国投资年度排名颁奖典礼”在上海隆重举行。博时基金荣获“年度值得信任卓越基金公司”。

2019 年 12 月 10 日, 投资时报“见未来”——2019 第二届资本市场高峰论坛暨金禧奖年度颁奖盛典在京举办, 博时基金荣获投资时报颁发的 2019 年度金禧奖“2019 最佳公募基金公司奖”。

2019 年 12 月 5 日, 金融界“大变局·大视野·大未来”——第四届智能金融国际论坛暨 2019 金融

界“领航中国”年度盛典在北京举行，博时基金斩获四项大奖，博时基金荣获“杰出年度基金公司奖”，凭借在金融科技方面的杰出贡献，获得“杰出年度智能金融品牌奖”，博时基金总经理江向阳荣获“杰出年度基金领袖奖”，博时基金王俊荣获“杰出年度基金经理奖”。

2019 年 12 月 5 日，21 世纪财经“金帆奖”颁奖典礼在广州举行，博时基金凭借在业内所取得的突出成就与贡献，获得“2019 年度基金管理公司金帆奖”。

2019 年 11 月 29 日，《经济观察报》在北京举办了“卓越金融企业”颁奖典礼，博时基金荣获“年度卓越综合实力基金公司”奖项。

2019 年 11 月 29 日，北京商报“寻路未来金融”——2019 年度北京金融论坛在京举办，博时基金凭借优秀的投研能力及全面的产品布局，荣获“北京金融业十大金融品牌——产品创新奖”。

2019 年 11 月 28 日，新浪财经 2019 新浪金麒麟论坛•ESG 峰会在北京举办，会上公布了 2019 中国企业 ESG“金责奖”评选名单，意在嘉奖那些对中国 ESG 事业做出卓越贡献的企业和机构，博时基金荣获 2019 中国企业 ESG 金责奖——“责任投资最佳基金公司奖”。

2019 年 11 月 22 日，2019 年度中国金融发展论坛暨金鼎奖颁奖典礼在北京举行，在资产管理领域甄选出了一批优质的标杆企业。群雄逐鹿百舸争流，博时基金跻身新资管时代的佼佼者，成功斩获“普惠金融奖”和“最佳海外固收产品奖”两项荣誉。

2019 年 11 月 15 日，中国经济网“2019 中国金融服务于创新论坛”在北京举办，博时基金荣获“金融服务 100 强”及“金融创新 100 强”称号。

2019 年 11 月 15 日，2019 年度第一财经金融价值榜（CFV）颁奖典礼在上海举行，博时基金凭借优秀的资产管理能力摘得“年度金融机构”奖项。

2019 年 11 月 9 日，人民日报社《国际金融报》和河南省商丘市人民政府共同主办的“第三届资本市场扶贫高峰论坛”在商丘市举办，博时基金荣获“年度扶贫企业奖”。

2019 年 10 月，由中国网主办的 2019 年度第二届“中国网之优秀金融扶贫先锋榜”评选活动圆满结束，经过多轮线上投票和业内专家、学者的专业评审，博时基金荣获“精准扶贫先锋机构”奖。

2019 年 9 月 27 日，《证券时报》主办的“2019 中国 AI 金融探路者峰会暨第三届中国金融科技先锋榜”颁奖典礼在深圳举行，博时基金凭借“新一代投资决策支持平台”项目，获登“中国公募基金智能投研先锋榜”。

2019 年 8 月 17 日，第二届济安五星基金“群星汇”暨颁奖典礼在京举行，博时基金斩获基金公司综合奖“群星奖”、“众星奖”、“五星奖”，基金产品单项奖“货币型基金管理奖”、“QDII 基金管理奖”以及 2 项“五星基金明星奖”等 7 项大奖，彰显出老牌基金公司强大的实力底蕴。

2019 年 7 月 5 日，2019 金牛基金高峰论坛暨第十六届中国基金金牛奖颁奖典礼在北京进行，

博时基金研究部总经理王俊和固定收益总部专户组投资总监张李陵分别获得“人气金牛”奖项，两位各自管理的绩优产品博时主题行业混合(LOF) (160505) 和博时信用债纯债债券 (050027) 分别荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖和“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

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”奖。

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发展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       |        |  |
| 邓欣雨 | 基金经理 | 2016-08-30      | 2019-03-04 | 11.6   | 邓欣雨先生，硕士。2008 年硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任固定收益研究员、固定收益研究员兼基金经理助理、博时聚瑞纯债债券型证券投资基金(2016 年 5 月 26 日-2017 年 11 月 8 日)、博时富祥纯债债券型证券投资基金(2016 年 11 月 10 日-2017 年 11 月 16 日)、博时聚利纯债债券型证券投资基金(2016 年 9 月 18 日-2017 年 11 月 22 日)、博时兴盛货币市场基金(2016 年 12 月 21 日-2017 年 12 月 29 日)、博时泰和债券型证券投资基金(2016 年 5 月 25 日-2018 年 3 月 9 日)、博时兴荣货币市场基金(2017 年 2 月 24 日-2018 年 3 月 19 日)、博时悦楚纯债债券型证券投资基金(2016 年 9 月 9 日-2018 年 4 月 9 日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2015 年 7 月 16 日-2018 年 5 月 5 日)、博时慧选纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 19 日-2018 年 7 月 30 日)、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 7 月 30 日-2018 年 8 月 9 日)、博时利发纯债债券型证券投 |

|    |      |            |   |     |   |
|----|------|------------|---|-----|---|
|    |      |            |   |     | <p>资基金(2016年9月7日-2018年11月6日)、博时景发纯债债券型证券投资基金(2016年8月3日-2018年11月19日)、博时转债增强债券型证券投资基金(2013年9月25日-2019年1月28日)、博时富元纯债债券型证券投资基金(2017年2月16日-2019年2月25日)、博时裕利纯债债券型证券投资基金(2016年5月9日-2019年3月4日)、博时聚盈纯债债券型证券投资基金(2016年7月27日-2019年3月4日)、博时聚润纯债债券型证券投资基金(2016年8月30日-2019年3月4日)、博时富发纯债债券型证券投资基金(2016年9月7日-2019年3月4日)、博时富诚纯债债券型证券投资基金(2017年3月17日-2019年3月4日)、博时富和纯债债券型证券投资基金(2017年8月30日-2019年3月4日)的基金经理。现任博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)(2018年4月23日—至今)、博时转债增强债券型证券投资基金(2019年4月25日—至今)的基金经理。</p> |
| 陈黎 | 基金经理 | 2019-03-04 | - | 5.6 | <p>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—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—至今)、博时富祥纯债债券型证券投资基金(2018年10月29日—</p>  |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | 至今)、博时裕安纯债债券型证券投资基金(2019年1月16日—至今)、博时富融纯债债券型证券投资基金(2019年1月29日—至今)、博时景发纯债债券型证券投资基金(2019年2月25日—至今)、博时聚盈纯债债券型证券投资基金(2019年3月4日—至今)、博时富源纯债债券型证券投资基金(2019年3月4日—至今)、博时聚润纯债债券型证券投资基金(2019年3月4日—至今)、博时裕利纯债债券型证券投资基金(2019年3月4日—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—至今)、博时裕达纯债债券型证券投资基金(2019年3月11日—至今)、博时裕康纯债债券型证券投资基金(2019年3月11日—至今)、博时富淳纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2019年7月18日—至今)、博时富汇纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2019年8月16日—至今)、博时富兴纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2019年8月19日—至今)、博时富元纯债债券型证券投资基金(2019年8月19日—至今)、博时富顺纯债债券型证券投资基金(2019年10月31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 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了《公平交易管理制度》，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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 144 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 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

2019 年，债券市场整体延续了 2018 年的牛市走势，但收益率波动增大，且不同品种走势分化。收益率全年呈现宽幅震荡格局，2019 年 1-2 月受益于短端资金面非常宽松，基本面预期较差，利率快速下行，3-4 月基本面数据回升，市场预期经济企稳复苏，收益率大幅上行，5 月随着中美贸易冲突加剧且经济复苏证伪，收益率再度下行，8 月进一步突破年初低点；10 月，猪肉价格快速上涨，CPI 上行超出预期，市场担忧央行货币政策受到掣肘，债券收益率再度出现大幅上行；11 月初央行下调 MLF 利率，市场预期修正，同时四季度资金面非常宽松，带动利率曲线下行。品种分化较大，信用利差压缩，信用债表现优于利率债，受益于隐性债务置换政策的中低等级城投债涨幅最大，但中低等级产业债及民企债的违约风险仍在进一步暴露。从指数看，中债总财富指数上涨 4.36%，中债国债总财富指数上涨 3.94%，中债企业债总财富指数上涨了 6.48%，中债短融总财富指数上涨了 3.72%。



#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 1.0337 元，份额累计净值为 1.1055 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 2.77%，同期业绩基准增长率 4.28%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年上半年市场的核心影响因素是新型冠状病毒肺炎的防控及影响。春节以后债券利率已经出现大幅下行，但本次新型冠状病毒肺炎发展尚未到拐点阶段，其对社会和经济的负面影响的程度如何，不确定性仍然较强。落脚到 2020 年一季度，我们认为新型肺炎即使逐步出现拐点也难尚完全控制，同时对经济的负面影响仍然在逐步体现，货币政策将维持宽松，债券市场仍然处于比较有利的环境中，但在肺炎防控的过程中，伴随着逐步复工和恢复正常的经济社会秩序，市场预期会出现波动，可能会提供交易性机会。

本组合遵循稳定防守的投资理念，投资思路上保持谨慎乐观，策略上以配置信用债为主，保持适度杠杆，但要严格控制信用风险。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

2019 年，我公司根据法律、法规的规定，制定了《基金中基金投资管理办法》、《科创板投资管理制度》、《反洗钱政策手册》等制度文件。修订了《博时基金管理有限公司章程》、《法定信息披露制度及流程》等制度文件，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断建设及完善“新一代投资决策支持系统”、“博时客户关系管理系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

收益分配原则：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。

#### 4.9 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

## 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

# §6 审计报告

安永华明（2020）审字第 60669135\_A06 号

博时聚润纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人：

## 6.1 审计意见

我们审计了博时聚润纯债债券型证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的博时聚润纯债债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了博时聚润纯债债券型证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博时聚润纯债债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 其他信息

博时聚润纯债债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信

息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估博时聚润纯债债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督博时聚润纯债债券型证券投资基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对博时聚润纯债债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博时聚润纯债债券型证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师 王珊珊

中国注册会计师 贺 耀

中国 北京

2020 年 3 月 26 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：博时聚润纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         | -                       | -                        |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 10,159,843.73           | 8,283,402.27             |
| 结算备付金      |         | -                       | -                        |
| 存出保证金      |         | -                       | -                        |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 1,012,439,500.00        | 970,940,000.00           |
| 其中：股票投资    |         | -                       | -                        |
| 基金投资       |         | -                       | -                        |

|                   |            |                                 |                                  |
|-------------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 债券投资              |            | 1,012,439,500.00                | 970,940,000.00                   |
| 资产支持证券投资          |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资             |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产            | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产          | 7.4.7.4    | -                               | 10,000,135.00                    |
| 应收证券清算款           |            | -                               | -                                |
| 应收利息              | 7.4.7.5    | 10,914,652.84                   | 16,687,344.79                    |
| 应收股利              |            | -                               | -                                |
| 应收申购款             |            | 1,466.83                        | -                                |
| 递延所得税资产           |            | -                               | -                                |
| 其他资产              | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| <b>资产总计</b>       |            | <b>1,033,515,463.40</b>         | <b>1,005,910,882.06</b>          |
| <b>负债和所有者权益</b>   | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债:</b>       |            | -                               | -                                |
| 短期借款              |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债            | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款         |            | -                               | -                                |
| 应付证券清算款           |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款             |            | -                               | 15.00                            |
| 应付管理人报酬           |            | 262,701.93                      | 255,722.18                       |
| 应付托管费             |            | 87,567.31                       | 85,240.73                        |
| 应付销售服务费           |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用            | 7.4.7.7    | 2,500.00                        | 2,605.00                         |
| 应交税费              |            | 87,458.04                       | 79,470.56                        |
| 应付利息              |            | -                               | -                                |
| 应付利润              |            | -                               | -                                |
| 递延所得税负债           |            | -                               | -                                |
| 其他负债              | 7.4.7.8    | 169,300.00                      | 340,000.02                       |
| <b>负债合计</b>       |            | <b>609,527.28</b>               | <b>763,053.49</b>                |
| <b>所有者权益:</b>     |            | -                               | -                                |
| 实收基金              | 7.4.7.9    | 999,263,796.83                  | 999,303,950.07                   |
| 未分配利润             | 7.4.7.10   | 33,642,139.29                   | 5,843,878.50                     |
| <b>所有者权益合计</b>    |            | <b>1,032,905,936.12</b>         | <b>1,005,147,828.57</b>          |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |            | <b>1,033,515,463.40</b>         | <b>1,005,910,882.06</b>          |

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.0337 元，基金份额总额 999,263,796.83 份。

## 7.2 利润表

会计主体：博时聚润纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号      | 本期<br>2019年1月1日至<br>2019年12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至<br>2018年12月31日 |
|----------------------------|----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| <b>一、收入</b>                |          | <b>32,235,800.76</b>            | <b>44,024,211.14</b>                 |
| 1.利息收入                     |          | 39,201,648.66                   | 44,982,501.64                        |
| 其中：存款利息收入                  | 7.4.7.11 | 70,002.26                       | 77,019.62                            |
| 债券利息收入                     |          | 39,127,027.43                   | 44,891,310.13                        |
| 资产支持证券利息收入                 |          | -                               | -                                    |
| 买入返售金融资产收入                 |          | 4,618.97                        | 14,171.89                            |
| 证券出借利息收入                   |          | -                               | -                                    |
| 其他利息收入                     |          | -                               | -                                    |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | -5,092,770.19                   | -2,652,280.22                        |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.12 | -                               | -                                    |
| 基金投资收益                     |          | -                               | -                                    |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.13 | -5,092,770.19                   | -2,652,280.22                        |
| 资产支持证券投资收益                 |          | -                               | -                                    |
| 贵金属投资收益                    |          | -                               | -                                    |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.14 | -                               | -                                    |
| 股利收益                       | 7.4.7.15 | -                               | -                                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 7.4.7.16 | -1,873,553.52                   | 1,693,894.51                         |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -                               | -                                    |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 7.4.7.17 | 475.81                          | 95.21                                |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>4,436,873.77</b>             | <b>4,601,440.64</b>                  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2 | 3,056,780.54                    | 3,053,383.67                         |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2 | 1,018,926.85                    | 1,017,794.58                         |
| 3. 销售服务费                   |          | -                               | -                                    |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.18 | 14,570.00                       | 13,865.00                            |
| 5. 利息支出                    |          | -                               | -                                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -                               | -                                    |
| 6. 税金及附加                   |          | 131,319.17                      | 127,046.06                           |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.19 | 215,277.21                      | 389,351.33                           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>27,798,926.99</b>            | <b>39,422,770.50</b>                 |
| 减：所得税费用                    |          | -                               | -                                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>27,798,926.99</b>            | <b>39,422,770.50</b>                 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时聚润纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年12月31日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2019年1月1日至2019年12月31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）                        | 999,303,950.07                   | 5,843,878.50   | 1,005,147,828.57 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 27,798,926.99  | 27,798,926.99    |
| 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）      | -40,153.24                       | -666.20        | -40,819.44       |
| 其中：1.基金申购款                             | 140,325.30                       | 2,976.20       | 143,301.50       |
| 2.基金赎回款                                | -180,478.54                      | -3,642.40      | -184,120.94      |
| 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）                        | 999,263,796.83                   | 33,642,139.29  | 1,032,905,936.12 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年12月31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）                        | 999,367,109.95                   | 1,097,850.96   | 1,000,464,960.91 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 39,422,770.50  | 39,422,770.50    |
| 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）      | -63,159.88                       | -2.30          | -63,162.18       |
| 其中：1.基金申购款                             | 167,716.10                       | 2,455.91       | 170,172.01       |
| 2.基金赎回款                                | -230,875.98                      | -2,458.21      | -233,334.19      |
| 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） | -                                | -34,676,740.66 | -34,676,740.66   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 999,303,950.07                   | 5,843,878.50   | 1,005,147,828.57 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

博时聚润纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2016]966号《关于准予博时聚润纯债债券型证券投资基金注册的批复》的注册,由基金管理人博时基金管理有限公司向社会公开募集。基金合同于2016年8月30日生效,首次设立募集规模为200,511,111.70份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为博时基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要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、中小企业私募债券、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、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。本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。本基金的业绩比较基准为:中债综合财富(总值)指数收益率 $\times 90\%$ +1年期定期存款利率(税后) $\times 10\%$ 。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2019年12月31日的财务状况以及2019年度的经营成果和净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要为债券投资；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；

保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (2) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的债券投资等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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用

最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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)不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(6)公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3)每一基金份额享有同等分配权；

(4)法律法规或监管机关另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

无。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资

管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 7.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|----|-----|------|
|----|-----|------|

|                | 2019 年 12 月 31 日 | 2018 年 12 月 31 日 |
|----------------|------------------|------------------|
| 活期存款           | 10,159,843.73    | 8,283,402.27     |
| 定期存款           | -                | -                |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                | -                |
| 存款期限 1-3 个月    | -                | -                |
| 存款期限 3 个月以上    | -                | -                |
| 其他存款           | -                | -                |
| 合计             | 10,159,843.73    | 8,283,402.27     |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2019 年 12 月 31 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                    | -                | -                |              |
|               | 银行间市场                    | 1,012,113,412.42 | 1,012,439,500.00 | 326,087.58   |
|               | 合计                       | 1,012,113,412.42 | 1,012,439,500.00 | 326,087.58   |
| 资产支持证券        | -                        | -                | -                |              |
| 基金            | -                        | -                | -                |              |
| 其他            | -                        | -                | -                |              |
| 合计            | 1,012,113,412.42         | 1,012,439,500.00 | 326,087.58       |              |
| 项目            | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 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                    | -                | -                |              |
|               | 银行间市场                    | 968,740,358.90   | 970,940,000.00   | 2,199,641.10 |
|               | 合计                       | 968,740,358.90   | 970,940,000.00   | 2,199,641.10 |
| 资产支持证券        | -                        | -                | -                |              |
| 基金            | -                        | -                | -                |              |
| 其他            | -                        | -                | -                |              |
| 合计            | 968,740,358.90           | 970,940,000.00   | 2,199,641.10     |              |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。



#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2019 年 12 月 31 日  |           |
|-------|--------------------------|-----------|
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                        | -         |
| 银行间市场 | -                        | -         |
| 合计    | -                        | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                        | -         |
| 银行间市场 | 10,000,135.00            | -         |
| 合计    | 10,000,135.00            | -         |

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 2,237.34                | 1,991.37                 |
| 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  | -                       | -                        |
| 应收债券利息     | 10,912,415.50           | 16,673,806.02            |
| 应收资产支持证券利息 | -                       | -                        |
| 应收买入返售证券利息 | -                       | 11,547.40                |
| 应收申购款利息    | -                       | -                        |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                       | -                        |
| 应收出借证券利息   | -                       | -                        |
| 其他         | -                       | -                        |
| 合计         | 10,914,652.84           | 16,687,344.79            |

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|----|-------------------------|--------------------------|
|    |                         |                          |

|             |          |          |
|-------------|----------|----------|
| 交易所市场应付交易费用 | -        | -        |
| 银行间市场应付交易费用 | 2,500.00 | 2,605.00 |
| 合计          | 2,500.00 | 2,605.00 |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | -                       | 0.02                     |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 其他应付款       | -                       | -                        |
| 预提费用        | 169,300.00              | 340,000.00               |
| 合计          | 169,300.00              | 340,000.02               |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |                |
|---------------|--|----------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额           |
| 上年度末          | 999,303,950.07                         | 999,303,950.07 |
| 本期申购          | 140,325.30                             | 140,325.30     |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -180,478.54                            | -180,478.54    |
| 本期末           | 999,263,796.83                         | 999,263,796.83 |

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 7.4.7.10 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       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | 4,601,405.23  | 1,242,473.27  | 5,843,878.50  |
| 本期利润           | 29,672,480.51 | -1,873,553.52 | 27,798,926.99 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -636.94       | -29.26        | -666.20       |
| 其中：基金申购款       | 2,959.54      | 16.66         | 2,976.20      |
| 基金赎回款          | -3,596.48     | -45.92        | -3,642.40     |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 34,273,248.80 | -631,109.51   | 33,642,139.29 |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年<br>12 月 31 日 |
|----------|---|--|
| 活期存款利息收入 | 70,002.26                                 | 77,019.62                                      |

|           |           |           |
|-----------|-----------|-----------|
| 定期存款利息收入  | -         | -         |
| 其他存款利息收入  | -         | -         |
| 结算备付金利息收入 | -         | -         |
| 其他        | -         | -         |
| 合计        | 70,002.26 | 77,019.62 |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

无发生额。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|
|                        | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 2,273,884,590.46      | 2,378,010,418.15      |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,232,857,141.98      | 2,332,998,941.09      |
| 减：应收利息总额               | 46,120,218.67         | 47,663,757.28         |
| 买卖债券差价收入               | -5,092,770.19         | -2,652,280.22         |

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

无发生额。

#### 7.4.7.15 股利收益

无发生额。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|
|                        | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 1.交易性金融资产              | -1,873,553.52         | 1,693,894.51          |
| ——股票投资                 | -                     | -                     |
| ——债券投资                 | -1,873,553.52         | 1,693,894.51          |
| ——资产支持证券投资             | -                     | -                     |
| ——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                     | -1,873,553.52         | 1,693,894.51          |

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期                    | 上年度可比期间               |
|---------|-----------------------|-----------------------|
|         | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 基金赎回费收入 | 23.48                 | 95.21                 |
| 基金转换费收入 | 452.33                | -                     |
| 合计      | 475.81                | 95.21                 |

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产；  
 2.本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成。

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
|           | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | -                     | -                     |
| 银行间市场交易费用 | 14,570.00             | 13,865.00             |
| 合计        | 14,570.00             | 13,865.00             |

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

| 项目       | 本期                    | 上年度可比期间               |
|----------|-----------------------|-----------------------|
|          | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 审计费用     | 40,000.00             | 40,000.00             |
| 信息披露费    | 120,000.00            | 300,000.00            |
| 证券出借违约金  | -                     | -                     |
| 银行汇划费    | 8,777.21              | 12,151.33             |
| 中债登账户维护费 | 22,500.00             | 18,000.00             |
| 上清所账户维护费 | 24,000.00             | 19,200.00             |
| 其他       | -                     | -                     |
| 合计       | 215,277.21            | 389,351.33            |

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**
**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

**7.4.8.2 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。

**7.4.9 关联方关系**

| 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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司(“招商银行”) | 基金托管人               |
| 招商证券股份有限公司(“招商证券”) | 基金管理人股东             |
| 中国长城资产管理股份有限公司     | 基金管理人股东             |
| 广厦建设集团有限责任公司       | 基金管理人股东             |
| 天津港(集团)有限公司        | 基金管理人股东             |
| 上海汇华实业有限公司         | 基金管理人股东             |
| 上海盛业股权投资基金有限公司     | 基金管理人股东             |
| 博时资本管理有限公司         | 基金管理人子公司            |
| 博时基金(国际)有限公司       | 基金管理人子公司            |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2019年1月1日至2019年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年<br>12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,056,780.54                    | 3,053,383.67                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 100.51                          | 161.25                               |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

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

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年1月1日至2019年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年<br>12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,018,926.85                    | 1,017,794.58                         |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**

无。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**
**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**7.4.10.5.2 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。

**7.4.10.6 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                    |           | 上年度可比期间               |           |
|-------|-----------------------|-----------|-----------------------|-----------|
|       | 2019年1月1日至2019年12月31日 |           | 2018年1月1日至2018年12月31日 |           |
|       | 期末余额                  | 当期利息收入    | 期末余额                  | 当期利息收入    |
| 招商银行  | 10,159,843.73         | 70,002.26 | 8,283,402.27          | 77,019.62 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率/约定利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

2019 年度：无(2018 年度：本基金买入 500,000 张托管人发行的银行同业存单，成交总额为 49,411,542.73 元)。

**7.4.11 利润分配情况**

无。

**7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**
**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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，将风险控制在此可承受的范围内。

##### 7.4.13.2 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约责任，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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级度的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以

控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.2.1 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<br>2019年12月31日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | 210,550,000.00     | 90,981,000.00       |
| A-1 以下 | -                  | -                   |
| 未评级    | 389,996,000.00     | 652,659,000.00      |
| 合计     | 600,546,000.00     | 743,640,000.00      |

注：未评级债券为短期融资券、存续期在一年以内的政策性金融债。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

#### 7.4.13.2.3 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<br>2019年12月31日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1 以下 | -                  | -                   |
| 未评级    | -                  | 117,152,000.00      |
| 合计     | -                  | 117,152,000.00      |

#### 7.4.13.2.4 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<br>2019年12月31日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 351,483,500.00     | 49,644,000.00       |
| AAA 以下 | -                  | -                   |
| 未评级    | 60,410,000.00      | 60,504,000.00       |
| 合计     | 411,893,500.00     | 110,148,000.00      |

注：未评级债券为存续期在一年以上的政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金主要投资于上市交易的证券除小部分流通受限证券外，其余均能及时变现。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资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### **7.4.13.3.1 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### **7.4.13.4 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。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因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。

##### **7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

| 本期末<br>2019 年 12 月 31 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                    | 10,159,843.73         | -                     | -            | -                    | 10,159,843.73           |
| 结算备付金                   | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |
| 存出保证金                   | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |
| 交易性金融资产                 | 851,432,500.00        | 161,007,000.00        | -            | -                    | 1,012,439,500.00        |
| 应收证券清算款                 | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |
| 买入返售金融资产                | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |
| 应收利息                    | -                     | -                     | -            | 10,914,652.84        | 10,914,652.84           |
| 应收申购款                   | -                     | -                     | -            | 1,466.83             | 1,466.83                |
| 应收股利                    | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |
| 其他资产                    | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |
| <b>资产总计</b>             | <b>861,592,343.73</b> | <b>161,007,000.00</b> | <b>-</b>     | <b>10,916,119.67</b> | <b>1,033,515,463.40</b> |
| <b>负债</b>               |                       |                       |              |                      |                         |
| 卖出回购金融资产款               | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |
| 应付赎回款                   | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |
| 应付证券清算款                 | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |
| 应付管理人报酬                 | -                     | -                     | -            | 262,701.93           | 262,701.93              |
| 应付托管费                   | -                     | -                     | -            | 87,567.31            | 87,567.31               |
| 应付销售服务费                 | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |
| 应交税费                    | -                     | -                     | -            | 87,458.04            | 87,458.04               |
| 应付交易费用                  | -                     | -                     | -            | 2,500.00             | 2,500.00                |
| 应付利息                    | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |
| 其他负债                    | -                     | -                     | -            | 169,300.00           | 169,300.00              |
| <b>负债总计</b>             | <b>-</b>              | <b>-</b>              | <b>-</b>     | <b>609,527.28</b>    | <b>609,527.28</b>       |
| <b>利率敏感度缺口</b>          | <b>861,592,343.73</b> | <b>161,007,000.00</b> | <b>-</b>     | <b>10,306,592.39</b> | <b>1,032,905,936.12</b> |
| <b>上年度末</b>             |                       |                       |              |                      |                         |
| <b>2018 年 12 月 31 日</b> | <b>1 年以内</b>          | <b>1-5 年</b>          | <b>5 年以上</b> | <b>不计息</b>           | <b>合计</b>               |
| <b>资产</b>               |                       |                       |              |                      |                         |
| 银行存款                    | 8,283,402.27          | -                     | -            | -                    | 8,283,402.27            |
| 结算备付金                   | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |
| 存出保证金                   | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |
| 交易性金融资产                 | 951,320,000.00        | 19,620,000.00         | -            | -                    | 970,940,000.00          |
| 应收证券清算款                 | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |
| 买入返售金融资产                | 10,000,135.00         | -                     | -            | -                    | 10,000,135.00           |
| 应收利息                    | -                     | -                     | -            | 16,687,344.79        | 16,687,344.79           |
| 应收申购款                   | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |
| 应收股利                    | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |
| 其他资产                    | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |
| <b>资产总计</b>             | <b>969,603,537.27</b> | <b>19,620,000.00</b>  | <b>-</b>     | <b>16,687,344.79</b> | <b>1,005,910,882.06</b> |
| <b>负债</b>               |                       |                       |              |                      |                         |
| 卖出回购金融资产款               | -                     | -                     | -            | -                    | -                       |

|                |                       |                      |   |                      |                         |
|----------------|-----------------------|----------------------|---|----------------------|-------------------------|
| 应付赎回款          | -                     | -                    | - | 15.00                | 15.00                   |
| 应付证券清算款        | -                     | -                    | - | -                    | -                       |
| 应付管理人报酬        | -                     | -                    | - | 255,722.18           | 255,722.18              |
| 应付托管费          | -                     | -                    | - | 85,240.73            | 85,240.73               |
| 应付销售服务费        | -                     | -                    | - | -                    | -                       |
| 应交税费           | -                     | -                    | - | 79,470.56            | 79,470.56               |
| 应付交易费用         | -                     | -                    | - | 2,605.00             | 2,605.00                |
| 应付利息           | -                     | -                    | - | -                    | -                       |
| 其他负债           | -                     | -                    | - | 340,000.02           | 340,000.02              |
| <b>负债总计</b>    | -                     | -                    | - | <b>763,053.49</b>    | <b>763,053.49</b>       |
| <b>利率敏感度缺口</b> | <b>969,603,537.27</b> | <b>19,620,000.00</b> | - | <b>15,924,291.30</b> | <b>1,005,147,828.57</b> |

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                                     |                              |                          |
|----|-------------------------------------|------------------------------|--------------------------|
| 假设 | 1. 该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；         |                              |                          |
|    | 2. 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变； |                              |                          |
|    | 3. 此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。  |                              |                          |
| 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<br>2019 年 12 月 31 日      | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|    | +25 个基准点                            | 减少约 156                      | 减少约 66                   |
|    | -25 个基准点                            | 增加约 156                      | 增加约 67                   |

注：表中为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对基金资产净值产生的影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

无。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金投资于固定收益类品种，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1)各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 0.00 元，第二层次的余额为人民币 1,012,439,500.00 元，第三层次的余额为人民币 0.00 元（上年度末：第一层次的余额为人民币 0.00 元，第二层次人民币 970,940,000.00 元，第三层次的余额为人民币 0.00 元）。

##### (2)公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期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，在第一层次和第二层次之间无重大转换（上年度：无）。本基金本报告期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未发生转入或转出第三层次公允价值的情况（上年度：无）。

##### 7.4.14.2 承诺事项

无。

##### 7.4.14.3 其他事项

无。

##### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2020 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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            | 1,012,439,500.00 | 97.96  |
|   | 其中：债券             | 1,012,439,500.00 | 97.96  |
|   | 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      | 10,159,843.73    | 0.98   |
| 8 | 其他各项资产            | 10,916,119.67    | 1.06   |
| 9 | 合计                | 1,033,515,463.40 | 100.00 |

## 8.2 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。

## 8.3 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。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

## 8.5 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      | 60,410,000.00  | 5.85         |
|    | 其中：政策性金融债 | 60,410,000.00  | 5.85         |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | 600,546,000.00 | 58.14        |
| 6  | 中期票据      | 351,483,500.00 | 34.03        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |

|    |      |                  |       |
|----|------|------------------|-------|
| 8  | 同业存单 | -                | -     |
| 9  | 其他   | -                | -     |
| 10 | 合计   | 1,012,439,500.00 | 98.02 |

### 8.6 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  | 041900253 | 19 沪港务 CP002   | 1,000,000 | 100,060,000.00 | 9.69         |
| 2  | 101761002 | 17 光大集团 MTN001 | 990,000   | 99,960,300.00  | 9.68         |
| 3  | 011902216 | 19 中铝 SCP014   | 1,000,000 | 99,910,000.00  | 9.67         |
| 4  | 101801335 | 18 浙交投 MTN001  | 600,000   | 60,630,000.00  | 5.87         |
| 5  | 011902583 | 19 豫高管 SCP003  | 600,000   | 59,898,000.00  | 5.80         |

### 8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 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。

### 8.11 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。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

#### 8.12.3 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 | -  |

|   |         |               |
|---|---------|---------------|
| 2 | 应收证券清算款 | -             |
| 3 | 应收股利    | -             |
| 4 | 应收利息    | 10,914,652.84 |
| 5 | 应收申购款   | 1,466.83      |
| 6 | 其他应收款   | -             |
| 7 | 待摊费用    | -             |
| 8 | 其他      | -             |
| 9 | 合计      | 10,916,119.67 |

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 |
| 271      | 3,687,320.28 | 999,200,798.20 | 99.99% | 62,998.63 | 0.01%  |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

### 9.3 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<br>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。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2016年8月30日)基金份额总额 | 200,511,111.70 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 999,303,950.07 |
| 本报告期基金总申购份额               | 140,325.30     |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 180,478.54     |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额              | 999,263,796.83 |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 11.2 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

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：基金管理人于 2019 年 8 月 24 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，董良泓先生不再担任博时基金管理有限公司副总经理职务。基金托管人在本报告期内重大人事变动情况：自 2019 年 12 月 18 日起，姜然女士不再担任招商银行股份有限公司总行资产托管部总经理职务。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 40,000 元。

### 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 国泰君安 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信建投 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

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；能根据公司所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。

### 11.7.2 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 |
| 国泰君安 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中信建投 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |

## 11.8 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  | 博时基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下博时聚润纯债债券型证券投资基金法律文件的公告 | 证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2019-12-31 |
| 2  | 博时聚润纯债债券型证券投资基金更新招募说明书（正文）                                 | 证券时报、基金管理人网站、            | 2019-12-31 |

|    |  |                          |            |
|----|--|--------------------------|------------|
|    |  | 证监会基金电子披露网站              |            |
| 3  | 博时聚润纯债债券型证券投资基金基金合同                    | 证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2019-12-31 |
| 4  | 博时聚润纯债债券型证券投资基金托管协议                    | 证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2019-12-31 |
| 5  | 博时聚润纯债债券型证券投资基金更新招募说明书（摘要）             | 证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2019-12-31 |
| 6  | 博时聚润纯债债券型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告         | 证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2019-10-23 |
| 7  | 博时聚润纯债债券型证券投资基金 2019 年半年度报告（摘要）        | 证券时报、基金管理人网站             | 2019-08-27 |
| 8  | 博时聚润纯债债券型证券投资基金 2019 年半年度报告（正文）        | 证券时报、基金管理人网站             | 2019-08-27 |
| 9  | 博时聚润纯债债券型证券投资基金 2019 年第 2 季度报告         | 证券时报、基金管理人网站             | 2019-07-18 |
| 10 | 博时聚润纯债债券型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告         | 证券时报、基金管理人网站             | 2019-04-22 |
| 11 | 博时聚润纯债债券型证券投资基金更新招募说明书 2019 年第 1 号（摘要） | 证券时报、基金管理人网站             | 2019-04-13 |
| 12 | 博时聚润纯债债券型证券投资基金更新招募说明书 2019 年第 1 号（正文） | 证券时报、基金管理人网站             | 2019-04-13 |
| 13 | 博时聚润纯债债券型证券投资基金 2018 年年度报告（正文）         | 证券时报、基金管理人网站             | 2019-03-29 |
| 14 | 博时聚润纯债债券型证券投资基金 2018 年年度报告（摘要）         | 证券时报、基金管理人网站             | 2019-03-29 |
| 15 | 博时基金管理有限公司关于博时聚润纯债债券型证券投资基金的基金经理变更的公告  | 证券时报、基金管理人网站             | 2019-03-05 |
| 16 | 博时聚润纯债债券型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告         | 证券时报、基金管理人网站             | 2019-01-19 |

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 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              | 2019-01-01~2019-12-31   | 999,200,798.20 | -    | -          | 999,200,798.20 | 99.99% |

### 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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 13.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时聚润纯债债券型证券投资基金设立的文件
- 13.1.2 《博时聚润纯债债券型证券投资基金基金合同》
- 13.1.3 《博时聚润纯债债券型证券投资基金托管协议》
- 13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 13.1.5 博时聚润纯债债券型证券投资基金年度审计报告正本
- 13.1.6 报告期内博时聚润纯债债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 13.3 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  
二〇二〇年三月二十七日