

博时富丰纯债 3 个月定期开放债券型发起
式证券投资基金
2020 年中期报告
2020 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：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月三十一日

§ 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。本中期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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	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
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
§4 管理人报告	6
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	10
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
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
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	15
§7 投资组合报告	28
7.1 期末基金资产组合情况	28
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	28
7.3 报告期内股票投资组合的重大变动	28
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	29
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	29
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	29
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	29
7.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	29
7.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	29
7.10 投资组合报告附注	30
§8 基金份额持有人信息	30
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	30
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	30
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	30
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	31
§9 开放式基金份额变动	31
§10 重大事件揭示	31
10.1 基金份额持有人大会决议	31

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	31
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	32
10.4 基金投资策略的改变	32
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	32
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	32
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	32
10.8 其他重大事件	33
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	33
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	34
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	34
§ 12 备查文件目录	34
12.1 备查文件目录	34
12.2 存放地点	34
12.3 查阅方式	35

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时富丰纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	博时富丰3个月定开债发起式
基金主代码	007513
交易代码	007513
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年6月26日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,985,988,654.50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	本基金为债券型基金。投资策略主要分为封闭期投资策略和开放期投资策略。封闭期内，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。本基金将灵活应用各种期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、个券挖掘策略、资产支持证券投资策略，在合理管理并控制组合风险的前提下，最大化组合收益。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。
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	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	石立平
	联系电话	0755-83169999	010-63639180
	电子邮箱	service@bosera.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		95105568	95595
传真		0755-83195140	010-63639132
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	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		518040	100033
法定代表人		江向阳	李晓鹏

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	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（2020年1月1日至2020年6月30日）
本期已实现收益	74,087,679.42
本期利润	56,819,701.69
加权平均基金份额本期利润	0.0227
本期加权平均净值利润率	2.20%
本期基金份额净值增长率	2.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	71,875,906.28
期末可供分配基金份额利润	0.0241
期末基金资产净值	3,060,990,415.79
期末基金份额净值	1.0251
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	5.20%

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

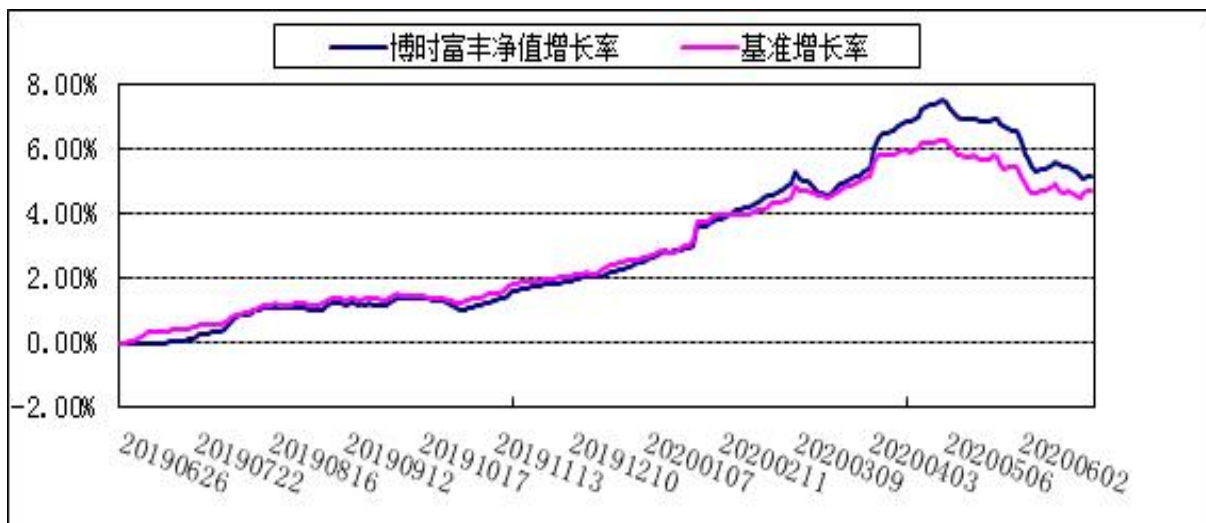
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.31%	0.13%	-0.60%	0.11%	-0.71%	0.02%
过去三个月	0.02%	0.14%	-0.16%	0.11%	0.18%	0.03%
过去六个月	2.77%	0.12%	2.19%	0.11%	0.58%	0.01%
过去一年	5.21%	0.09%	4.76%	0.08%	0.45%	0.01%
自基金合同生效起至今	5.20%	0.09%	4.84%	0.08%	0.36%	0.01%

注：本基金的业绩比较基准：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%。

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 6 月 26 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。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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 2020 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 224 只公募基金，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 12150 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 3882 亿元人民币，累计分红逾 1296 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。

2020 年 6 月 29 日，《证券时报》第十五届中国基金业明星基金奖榜单公布，博时基金共荣获三项大奖，旗下产品博时外延增长主题混合与博时宏观回报债券分别拿下“三年持续回报平衡混合型明星基金”与“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。博时信用债券基金摘得“十年持续回报债券型明星基金”奖。

2020 年 4 月 1 日，博时基金及子公司博时国际荣获《亚洲资产管理》2020 “Best of the Best Awards” 三项大奖。博时基金董事长兼总经理江向阳荣获“中国年度最佳 CEO” (Winner, China CEO

of the Year-Jiang Xiangyang)，博时基金（国际）有限公司荣获“香港最佳中资基金公司”（Winner, Hong Kong Best China Fund House），博时信用债基金荣获“中国在岸人民币债券最佳业绩（5年）”（Winner, CNY Bonds, Onshore 5 Years-Bosera Credit Bond Fund）。

2020年3月31日，《中国证券报》第十七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信用债纯债债券荣获“七年期开放式债券型持续优胜金牛基金奖”。

2020年3月26日，Morningstar晨星（中国）2020年度基金评选结果揭晓，博时信用债券在参选的同类428只基金中脱颖而出，摘得晨星“2020年度激进债券型基金奖”。

2020年1月10日，新京报“开放 普惠 科技”2019金融行业评选颁奖典礼在北京举办，博时基金凭借在可持续发展金融方面的努力成果，荣获“2019年度杰出社会责任影响力企业”。

2020年1月4日，2020《财经》可持续发展高峰论坛暨长青奖典礼在北京举办，博时基金凭借在ESG投资及可持续发展金融推动方面的耕耘和成果，荣获“2020《财经》长青奖-可持续发展创新奖”。

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		
倪玉娟	基金经理	2019-06-26	-	8.9	倪玉娟女士，博士。2011年至2014年在海通证券任固定收益分析师。2014年加入博时基金管理有限公司。历任高级研究员、高级研究员兼基金经理助理、博时悦楚纯债债券型证券投资基金（2018年4月9日-2019年6月4日）基金经理。现任博时富瑞纯债债券型证券投资基金（2018年4月9日-至今）、博时富业纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金（2018年7月16日-至今）、博时现金宝货币市场基金（2019年2月25日-至今）、博时富丰纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金（2019年6月26日-至今）、博时稳欣39个月定期开放债券型证券投资基金（2019年11月19日-至今）、博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金（2020年5月27日-至今）的基金经理。
黄海峰	基金经理	2019-07-08	-	10.2	黄海峰先生，学士。2004年起先后在深圳市农村商业银行、博时基金、银华基金、大成基金工作。2016年9月再次加入博时基金管理有限公司。历任博时裕通纯债债券型证券投资基金（2017年5月31日-2018年3月26日）、博时产业债纯债债券型证券投资

				基金(2017年5月31日-2018年5月30日)、博时盈海纯债债券型证券投资基金(2018年5月9日-2018年7月19日)、博时聚瑞纯债债券型证券投资基金(2017年11月8日-2018年9月3日)、博时富祥纯债债券型证券投资基金(2017年11月16日-2018年11月22日)、博时聚瑞纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018年9月3日-2018年11月22日)、博时裕安纯债债券型证券投资基金(2017年5月8日-2019年1月16日)、博时安荣18个月定期开放债券型证券投资基金(2017年6月15日-2019年3月2日)、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(2018年4月12日-2019年8月19日)、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金(2019年3月4日-2019年9月5日)的基金经理。现任博时裕景纯债债券型证券投资基金(2017年5月8日一至今)、博时裕腾纯债债券型证券投资基金(2017年5月8日一至今)、博时裕乾纯债债券型证券投资基金(2017年5月31日一至今)、博时裕鹏纯债债券型证券投资基金(2017年12月29日一至今)、博时民丰纯债债券型证券投资基金(2017年12月29日一至今)、博时富安纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018年2月2日一至今)、博时富乾纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018年2月8日一至今)、博时华盈纯债债券型证券投资基金(2018年3月15日一至今)、博时广利纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018年5月28日一至今)、博时富和纯债债券型证券投资基金(2019年3月4日一至今)、博时裕新纯债债券型证券投资基金(2017年5月8日一至今)、博时裕发纯债债券型证券投资基金(2017年5月8日一至今)、博时富腾纯债债券型证券投资基金(2018年5月9日一至今)、博时丰庆纯债债券型证券投资基金(2019年3月4日一至今)、博时
--	--	--	--	---

					富丰纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2019年7月8日一至今)、博时安心收益定期开放债券型证券投资基金(2016年12月28日一至今)、博时安盈债券型证券投资基金(2017年5月31日一至今)、博时安仁一年定期开放债券型证券投资基金(2017年11月8日一至今)、博时聚利纯债债券型证券投资基金(2017年11月22日一至今)、博时裕通纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018年3月26日一至今)、博时聚源纯债债券型证券投资基金(2018年11月22日一至今)、博时季季享三个月持有期债券型证券投资基金(2019年9月5日一至今)、博时信用优选债券型证券投资基金(2020年5月22日一至今)的基金经理。
郭思洁	基金经理助理	2019-07-16	2020-05-13	9	2011年至2014年在中山证券工作。2014年加入博时基金管理有限公司。历任交易员、高级交易员、基金经理助理。现任博时裕坤纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2020年5月13日一至今)、博时裕创纯债债券型证券投资基金(2020年5月13日一至今)、博时裕盛纯债债券型证券投资基金(2020年5月13日一至今)、博时裕诚纯债债券型证券投资基金(2020年5月13日一至今)、博时富华纯债债券型证券投资基金(2020年5月13日一至今)、博时裕瑞纯债债券型证券投资基金(2020年5月13日一至今)、博时裕恒纯债债券型证券投资基金(2020年5月13日一至今)、博时裕泰纯债债券型证券投资基金(2020年5月13日一至今)、博时裕昂纯债债券型证券投资基金(2020年5月13日一至今)、博时富发纯债债券型证券投资基金(2020年5月13日一至今)、博时裕泉纯债债券型证券投资基金(2020年5月13日一至今)、博时裕荣纯债债券型证券投资基金(2020年5月13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。管理人于 2020 年 7 月 22 日发布公告称，聘任郭思洁先生担任本基金基金经理，与倪玉娟女士共同担任本基金基金经理，黄海峰先生不再担任本基金基金经理。

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，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

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

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 93 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

上半年，债券市场主要受新冠疫情影响，收益率以 5 月为分水岭，先下后上。1-4 月，由于新冠疫情爆发，并在全球蔓延，金融市场开启避险模式，国内债市整体突破 2016 年低点，甚至一度下行至接近 2008 年金融危机的位置；但 5 月起，债市剧烈调整，中短端上行幅度尤其大。这主要是由于央行明确释放偏鹰信号，货币政策边际收敛，市场对货币中枢的预期明显抬升，叠加债券天量供给的冲击，导致收益率曲线经历惨烈重定价，中短端尤甚。从指数看，中债总财富指数上涨 2.66%，中债国债总财富指数上涨 2.75%，中债企业债总财富指数上涨 2.42%，中债短融总财富指数上涨 1.47%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.0251 元，份额累计净值为 1.0516 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 2.19%。

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，基本面上看，经济仍在持续改善，这一方面由于一季度经济受到疫情影响最大，基数较低，环比改善较明显；另一方面，也有之前受疫情压制的需求在二季度集中释放的影响，在需求集中释

放后，经济回升的力度仍存在一定不确定性。随着越来越多的行业的增速修复到疫情前的水平，复工复产驱动下的经济修复可能逐步趋于终结。另外，考虑到目前疫情在全球仍有反复迹象，疫情对经济的负面影响持续时间可能会比较长，恢复到疫情前的水平仍需时日。货币政策方面，央行5月以来的表态与操作已明确了货币政策的边际收敛，但由于疫情的影响仍未完全消除，微观主体特别是小微企业生存压力依然较大，就业压力依然存在，流动性方面大概率还是会维持总量相对宽松的格局。央行在半年末及7月税期的足量投放也反映了2.2%的政策利率附近是央行合意的资金利率中枢，其无意继续收紧货币环境。

综上，目前经济复苏的底子并不扎实，内外部面临的不确定性因素依然很大，货币政策尚不至于过快收紧。但在货币政策明确收敛，权益市场走强对债市形成一定压制的情况下，收益率短期也缺乏趋势性机会。预计债市短期将进入上顶下底都较为明确的宽幅振荡期。

本组合遵循稳健投资理念，投资策略上积极主动，投资思路开放灵活，维持适度久期优质债券配置。

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

本基金管理人于2020年3月12日发布公告，以2020年3月5日可分配利润为基准，每10份基金份额发放红利0.1730元人民币。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在博时富丰纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《博时富丰纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、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）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 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：博时富丰纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	156,674,350.86	3,207,764.15
结算备付金		23,259,403.47	17,144,880.07
存出保证金		42,113.32	68,878.49
交易性金融资产	6.4.3.2	3,971,703,800.00	2,653,705,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,971,703,800.00	2,653,705,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	80,222,441.68	44,300,281.28
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		4,231,902,109.33	2,718,426,803.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,018,829,337.70	678,124,170.81
应付证券清算款		150,193,869.19	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		754,993.94	517,854.43
应付托管费		251,664.64	172,618.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	83,273.77	55,442.31
应交税费		373,911.17	243,022.20
应付利息		328,321.65	304,699.34
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	96,321.48	64,300.00
负债合计		1,170,911,693.54	679,482,107.19
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	2,985,988,654.50	2,009,999,000.00
未分配利润	6.4.3.10	75,001,761.29	28,945,696.80
所有者权益合计		3,060,990,415.79	2,038,944,696.80
负债和所有者权益总计		4,231,902,109.33	2,718,426,803.99

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0251 元，基金份额总额 2,985,988,654.50 份。

6.2 利润表

会计主体：博时富丰纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年6月26日（基金合 同生效日）至2019年6月 30日
一、收入		75,206,746.37	-68,293.69
1. 利息收入		69,331,596.29	654,434.25
其中：存款利息收入	6.4.3.11	251,103.48	83,159.47
债券利息收入		69,047,410.14	23,156.30
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		33,082.67	548,118.48
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		23,143,127.81	-
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	23,143,127.81	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-17,267,977.73	-722,727.94
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-	-
减：二、费用		18,387,044.68	90,942.02
1. 管理人报酬		3,847,874.13	66,076.15
2. 托管费		1,282,624.66	22,025.38
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	61,033.52	111.63
5. 利息支出		12,863,693.15	-
其中：卖出回购金融资产支出		12,863,693.15	-
6. 税金及附加		226,197.74	83.36
7. 其他费用	6.4.3.19	105,621.48	2,645.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		56,819,701.69	-159,235.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		56,819,701.69	-159,235.71

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时富丰纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020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）	2,009,999,000.00	28,945,696.80	2,038,944,696.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	56,819,701.69	56,819,701.69
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）	975,989,654.50	24,009,345.50	999,999,000.00
其中：1. 基金申购款	975,989,654.50	24,009,345.50	999,999,000.00
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-34,772,982.70	-34,772,982.70
五、期末所有者权益（基金净值）	2,985,988,654.50	75,001,761.29	3,060,990,415.79
项目	上年度可比期间 2019年6月26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）	2,009,999,000.00	-	2,009,999,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-159,235.71	-159,235.71
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	2,009,999,000.00	-159,235.71	2,009,839,764.29

注：报表附注为财务报表的组成部分。

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

6.4.2.1 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。

6.4.2.2 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。

6.4.2.3 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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	156,674,350.86
定期存款	-
其他存款	-
合计	156,674,350.86

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020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	1,010,184,255.09	-756,455.09
	银行间市场	2,972,043,019.87	-9,767,019.87
	合计	3,982,227,274.96	-10,523,474.96
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,982,227,274.96	3,971,703,800.00	-10,523,474.96

6.4.3.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	3,808.81
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	10,466.70
应收债券利息	80,208,147.17
应收资产支持证券利息	-
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	-
应收出借证券利息	-
其他	19.00
合计	80,222,441.68

6.4.3.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020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	83,273.77
合计	83,273.77

6.4.3.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
其他应付款	-
预提费用	96,321.48
合计	96,321.48

6.4.3.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,009,999,000.00	2,009,999,000.00
本期申购	975,989,654.50	975,989,654.50
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,985,988,654.50	2,985,988,654.50

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.3.7 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	22,201,194.03	6,744,502.77	28,945,696.80
本期利润	74,087,679.42	-17,267,977.73	56,819,701.69
本期基金份额交易产生的变动数	10,360,015.53	13,649,329.97	24,009,345.50
其中：基金申购款	10,360,015.53	13,649,329.97	24,009,345.50
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-34,772,982.70	-	-34,772,982.70
本期末	71,875,906.28	3,125,855.01	75,001,761.29

6.4.3.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	91,146.95
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	159,599.23
其他	357.30
合计	251,103.48

6.4.3.9 股票投资收益

无发生额。

6.4.3.10 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,695,775,283.85
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,606,155,413.02
减：应收利息总额	66,476,743.02
买卖债券差价收入	23,143,127.81

6.4.3.11 股利收益

无发生额。

6.4.3.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-17,267,977.73
——股票投资	-
——债券投资	-17,267,977.73
——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	-17,267,977.73

6.4.3.13 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	723.52
银行间市场交易费用	60,310.00
交易基金产生的费用	0.00

其中：申购费	-
赎回费	-
基金交易费用	0.00
合计	61,033.52

6.4.3.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	27,349.14
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
中债登账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,600.00
合计	105,621.48

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

本基金管理人于2020年8月22日发布分红公告，以2020年8月18日为收益分配基准日，以2020年8月25日为权益登记日，于2020年8月27日进行了收益分配，具体情况详见分红公告。

截至财务报告批准报出日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	基金托管人、基金代销机构

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年6月26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	3,847,874.13	66,076.15

其中：支付销售机构的客户维护费	-	-
-----------------	---	---

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

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年6月26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	1,282,624.66	22,025.38

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

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
光大银行	-	-	-	-	150,041,000.00	8,410.91
上年度可比期间 2019年6月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

6.4.6.4 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

6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年6月26日（基金合同生效日） 至2019年6月30日
基金合同生效日 (2019年6月26日) 持有的基金份额	-	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	-

期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.33%	0.50%

6.4.6.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
光大银行	2,975,988,654.50	99.67%	1,999,999,000.00	99.50%

6.4.6.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年6月26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	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	156,674,350.86	91,146.95	9,325,656.20	83,159.47

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率/约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明
6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	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	利润分配合计	备注
1	2020-03-16	0.1730	34,772,982.70	-	34,772,982.70	-
合计		0.1730	34,772,982.70	-	34,772,982.70	-

6.4.8 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 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 568,229,337.70 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
101800767	18 越秀集团 MTN003	2020-07-01	105.15	85,000.00	8,937,750.00
101661012	16 皖交通 MTN001B	2020-07-01	102.40	100,000.00	10,240,000.00
200005	20 付息国债 05	2020-07-01	97.60	200,000.00	19,520,000.00
180205	18 国开 05	2020-07-01	110.11	200,000.00	22,022,000.00
190208	19 国开 08	2020-07-01	101.75	225,000.00	22,893,750.00
101801223	18 首钢 MTN004	2020-07-06	102.23	464,000.00	47,434,720.00
101900956	19 陕延油 MTN008	2020-07-01	101.90	500,000.00	50,950,000.00
1980405	19 济南城建 债 01	2020-07-02	100.84	548,000.00	55,260,320.00
102000066	20 苏国信 MTN001	2020-07-01	100.84	700,000.00	70,588,000.00
190208	19 国开 08	2020-07-01	101.75	928,000.00	94,424,000.00
101900906	19 京津冀 MTN002	2020-07-01	101.85	1,000,000.00	101,850,000.00
101759002	17 川发展 MTN001	2020-07-01	104.23	1,005,000.00	104,751,150.00
合计				5,955,000.00	608,871,690.00

6.4.8.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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 450,600,000.00 元，于 2020 年 07 月 06 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。

6.4.8.3 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 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，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.9.2 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。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无余额。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

6.4.9.2.3 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 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	97,050,000.00
合计	-	97,050,000.00

6.4.9.2.4 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 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
AAA	3,273,926,800.00	2,181,751,800.00
AAA 以下	523,960,000.00	374,903,200.00
未评级	173,817,000.00	-
合计	3,971,703,800.00	2,556,655,000.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

6.4.9.3 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。

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	156,674,350.86	-	-	-	156,674,350.86
结算备付金	23,259,403.47	-	-	-	23,259,403.47
存出保证金	42,113.32	-	-	-	42,113.32
交易性金融资产	354,195,800.00	3,595,486,000.00	22,022,000.00	-	3,971,703,800.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	80,222,441.68	80,222,441.68
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	534,171,667.65	3,595,486,000.00	22,022,000.00	80,222,441.68	4,231,902,109.33
负债					
卖出回购金融资产款	1,018,829,337.70	-	-	-	1,018,829,337.70
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	150,193,869.19	150,193,869.19
应付管理人报酬	-	-	-	754,993.94	754,993.94
应付托管费	-	-	-	251,664.64	251,664.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	373,911.17	373,911.17
应付交易费用	-	-	-	83,273.77	83,273.77
应付利息	-	-	-	328,321.65	328,321.65
其他负债	-	-	-	96,321.48	96,321.48
负债总计	1,018,829,337.70	-	-	152,082,355.84	1,170,911,693.54
利率敏感度缺口	-484,657,670.05	3,595,486,000.00	22,022,000.00	-71,859,914.16	3,060,990,415.79
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,207,764.15	-	-	-	3,207,764.15
结算备付金	17,144,880.07	-	-	-	17,144,880.07
存出保证金	68,878.49	-	-	-	68,878.49
交易性金融资产	239,382,000.00	2,414,323,000.00	-	-	2,653,705,000.00

					.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	44,300,281.28	44,300,281.28
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	259,803,522.71	2,414,323,000.00	-	44,300,281.28	2,718,426,803.99
负债					
卖出回购金融资产款	678,124,170.81	-	-	-	678,124,170.81
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	517,854.43	517,854.43
应付托管费	-	-	-	172,618.10	172,618.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	243,022.20	243,022.20
应付交易费用	-	-	-	55,442.31	55,442.31
应付利息	-	-	-	304,699.34	304,699.34
其他负债	-	-	-	64,300.00	64,300.00
负债总计	678,124,170.81	-	-	1,357,936.38	679,482,107.19
利率敏感度缺口	-418,320,648.10	2,414,323,000.00	-	42,942,344.90	2,038,944,696.80

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。

6.4.9.4.1.2 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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	+25个基准点	减少约 2,140	减少约 1,440
-25个基准点	增加约 2,160	增加约 1,453	

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。

6.4.9.4.2 外汇风险

无。

6.4.9.4.3 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。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

6.4.9.4.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.10.1 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，属于第二层次的余额为人民币 3,971,703,800.00 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元（上年度末：第一层次人民币 0.00 元，第二层次人民币 2,653,705,000.00 元，第三层次人民币 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）。

6.4.10.2 承诺事项

无。

6.4.10.3 其他事项

无。

§ 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	3,971,703,800.00	93.85
	其中：债券	3,971,703,800.00	93.85
	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	179,933,754.33	4.25
8	其他各项资产	80,264,555.00	1.90
9	合计	4,231,902,109.33	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 报告期内股票投资组合的重大变动

无。

7.4 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	19,520,000.00	0.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	256,237,000.00	8.37
	其中：政策性金融债	154,297,000.00	5.04
4	企业债券	1,110,960,800.00	36.29
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	2,584,986,000.00	84.45
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,971,703,800.00	129.75

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

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	190208	19国开08	1,300,000	132,275,000.00	4.32
2	101759002	17川发展MTN001	1,200,000	125,076,000.00	4.09
3	1822018	18兴业租赁债01	1,000,000	101,940,000.00	3.33
4	101900906	19京津冀MTN002	1,000,000	101,850,000.00	3.33
5	155738	19朝纾02	1,000,000	101,060,000.00	3.30

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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	42,113.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	80,222,441.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	80,264,555.00

7.10.4 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。

7.10.5 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 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
2	1,492,994,327.25	2,985,988,654.50	100.00%	0.00	0.00%

8.2 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。

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、基金投资和研究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。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金 总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金 总份额比例	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固 有资金	10,000,000.00	0.33%	10,000,000.00	0.33%	3年
基金管理人高 级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人 员	-	-	-	-	-
基金管理人股 东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.33%	10,000,000.00	0.33%	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年6月26日）基金份额总额	2,009,999,000.00
本报告期期初基金份额总额	2,009,999,000.00
本报告期基金总申购份额	975,989,654.50
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,985,988,654.50

§ 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

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：1、基金管理人于 2020 年 1 月 10 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》，张光华先生不再担任公司董事长职务，由公司总经理江向阳先生代为履行董事长职务。2、基金管理人于 2020 年 4 月 17 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》，江向阳先生任博时基金管理有限公司董事长。

本报告期内，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。

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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	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服务；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

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
中泰证券	554,411,809.89	98.23%	32,196,800,000.00	99.67%	-	-
长江证券	10,011,509.59	1.77%	105,000,000.00	0.33%	-	-

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	博时富丰纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-30
2	博时基金管理有限公司关于暂停使用中国银行理财直付服务办理直销网上交易部分业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
3	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
4	关于博时旗下部分基金参加招商银行申购及定投业务费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-01
5	博时富丰纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金2020年第1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	2020-04-22
6	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-04-17
7	博时富丰纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金2019年年度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-03-27
8	博时富丰纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-03-26
9	博时富丰纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-03-12
10	博时基金管理有限公司关于2020年春节假期延长期间暂停办理申购赎回等业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-28
11	博时富丰纯债3个月定期开放债券型发起式	证券时报、基金管理人	2020-01-17

	证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	网站、证监会基金电子披露网	
12	中国光大银行“投资与托管业务部”名称变更为“资产托管部”	中国证监会指定的媒介	2020-04-15

§ 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	2020-01-01~2020-06-30	1,999,999,000.00	975,989,654.50	0.00	2,975,988,654.50	99.67%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>							

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 中国证监会批准博时富丰纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时富丰纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时富丰纯债 3 个月定期开放债券型发起式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 博时富丰纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金各年度审计报告正本

12.1.6 报告期内在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

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
二〇二〇年八月三十一日