

**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
2020 年第 4 季度报告
2020 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：二〇二一年一月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 博时聚瑞 6 个月定开债发起式 |
| 基金主代码 | 002781 |
| 交易代码 | 002781 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 5 月 26 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,934,227,793.14 份 |
| 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 | <p>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。</p> <p>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。</p> |
| 业绩比较基准 | 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% |
| 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。 |

| | |
|-------|------------|
| 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 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2020年10月1日-2020年12月31日) |
|----------------|---------------------------------|
| 1.本期已实现收益 | 36,839,872.60 |
| 2.本期利润 | 48,920,457.26 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0099 |
| 4.期末基金资产净值 | 5,067,199,134.43 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0269 |

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。

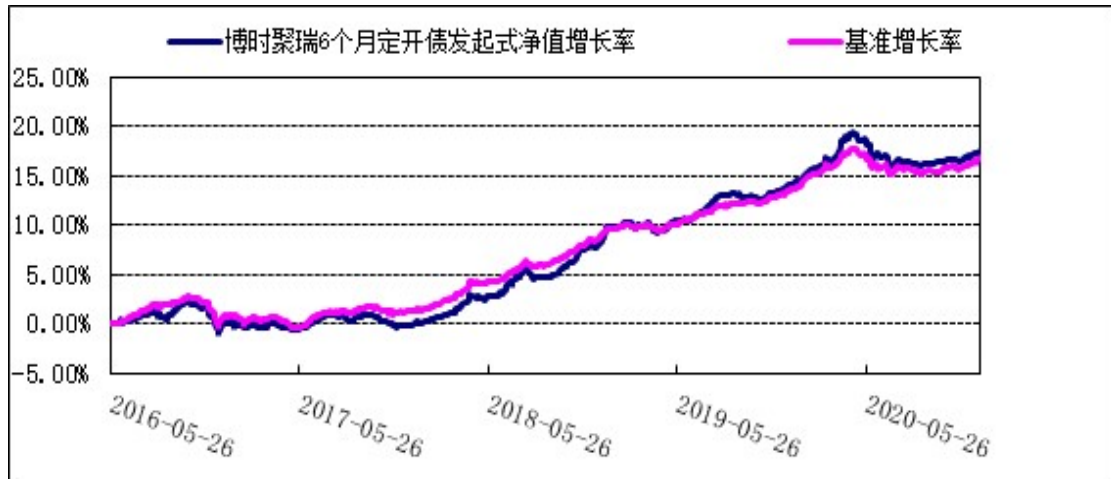
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.97% | 0.03% | 1.17% | 0.04% | -0.20% | -0.01% |
| 过去六个月 | 0.27% | 0.06% | 0.64% | 0.06% | -0.37% | 0.00% |
| 过去一年 | 2.90% | 0.10% | 2.83% | 0.09% | 0.07% | 0.01% |
| 过去三年 | 17.53% | 0.09% | 15.31% | 0.07% | 2.22% | 0.02% |
| 自基金合同生 效起至今 | 17.46% | 0.09% | 16.83% | 0.07% | 0.63% | 0.02% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------------------------------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈凯杨 | 公司董事 总经理/固定收益总部公募基金组负责人/基金经理 | 2018-11-22 | - | 15.3 | 陈凯杨先生，硕士。2003年起先后在深圳发展银行、博时基金、长城基金工作。2009年1月再次加入博时基金管理有限公司。历任固定收益研究员、特定资产投资经理、博时理财30天债券型证券投资基金(2013年1月28日-2015年9月11日)基金经理、固定收益总部现金管理组投资副总监、博时外服货币市场基金(2015年6月15日-2016年7月20日)、博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金(2013年6月26日-2016年12月15日)、博时裕瑞纯债债券型证券投资基金(2015年6月30日-2016年12月15日)、博时裕盈纯债债券型证券投资基金(2015年9月29日-2016年12月15日)、博时 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | 裕恒纯债债券型证券投资基金(2015 年 10 月 23 日-2016 年 12 月 15 日)、博时裕荣纯债债券型证券投资基金(2015 年 11 月 6 日-2016 年 12 月 15 日)、博时裕泰纯债债券型证券投资基金(2015 年 11 月 19 日-2016 年 12 月 27 日)、博时裕晟纯债债券型证券投资基金(2015 年 11 月 19 日-2016 年 12 月 27 日)、博时裕丰纯债债券型证券投资基金(2015 年 11 月 25 日-2016 年 12 月 27 日)、博时裕和纯债债券型证券投资基金(2015 年 11 月 27 日-2016 年 12 月 27 日)、博时裕坤纯债债券型证券投资基金(2015 年 11 月 30 日-2016 年 12 月 27 日)、博时裕嘉纯债债券型证券投资基金(2015 年 12 月 2 日-2016 年 12 月 27 日)、博时裕达纯债债券型证券投资基金(2015 年 12 月 3 日-2016 年 12 月 27 日)、博时裕康纯债债券型证券投资基金(2015 年 12 月 3 日-2016 年 12 月 27 日)、博时安心收益定期开放债券型证券投资基金(2012 年 12 月 6 日-2016 年 12 月 28 日)、博时裕腾纯债债券型证券投资基金(2016 年 1 月 18 日-2017 年 5 月 8 日)、博时裕安纯债债券型证券投资基金(2016 年 3 月 4 日-2017 年 5 月 8 日)、博时裕新纯债债券型证券投资基金(2016 年 3 月 30 日-2017 年 5 月 8 日)、博时裕发纯债债券型证券投资基金(2016 年 4 月 6 日-2017 年 5 月 8 日)、博时裕 |
|--|--|--|--|---|

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | 景纯债债券型证券投资基金(2016 年 4 月 28 日-2017 年 5 月 8 日)、博时裕乾纯债债券型证券投资基金(2016 年 1 月 15 日-2017 年 5 月 31 日)、博时裕通纯债债券型证券投资基金(2016 年 4 月 29 日-2017 年 5 月 31 日)、博时安和 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2016 年 1 月 26 日-2017 年 10 月 26 日)、博时安源 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2016 年 6 月 16 日-2018 年 3 月 8 日)、博时安誉 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2015 年 12 月 23 日-2018 年 3 月 15 日)、博时安泰 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2016 年 2 月 4 日-2018 年 3 月 15 日)、博时安祺一年定期开放债券型证券投资基金(2016 年 9 月 29 日-2018 年 3 月 15 日)、博时安诚 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2016 年 11 月 10 日-2018 年 5 月 28 日)、博时裕信纯债债券型证券投资基金(2016 年 10 月 25 日-2018 年 8 月 23 日)的基金经理、固定收益总部现金管理组负责人、博时现金收益证券投资基金(2015 年 5 月 22 日-2019 年 2 月 25 日)、博时裕顺纯债债券型证券投资基金(2016 年 6 月 23 日-2019 年 8 月 19 日)、博时安怡 6 个月定期开放债券型证券投资基金(2016 年 4 月 15 日-2019 年 12 月 16 日)、博时月月薪定期支付债券型证券投资基金(2013 年 |
|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 7 月 25 日-2020 年 5 月 13 日)、博时安瑞 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2016 年 3 月 30 日-2020 年 5 月 13 日)、博时裕弘纯债债券型证券投资基金(2016 年 6 月 17 日-2020 年 5 月 13 日)、博时裕昂纯债债券型证券投资基金(2016 年 7 月 15 日-2020 年 5 月 13 日)、博时裕泉纯债债券型证券投资基金(2016 年 9 月 7 日-2020 年 5 月 13 日)、博时裕诚纯债债券型证券投资基金(2016 年 10 月 31 日-2020 年 5 月 13 日)、博时合惠货币市场基金(2017 年 5 月 31 日-2020 年 5 月 13 日)、博时富华纯债债券型证券投资基金(2018 年 9 月 19 日-2020 年 5 月 13 日)、博时裕创纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日-2020 年 5 月 13 日)、博时裕盛纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日-2020 年 5 月 13 日)、博时富发纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日-2020 年 5 月 13 日)、博时裕恒纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 11 日-2020 年 5 月 13 日)、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(2019 年 3 月 11 日-2020 年 5 月 13 日)、博时裕泰纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 11 日-2020 年 5 月 13 日)、博时裕荣纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 11 日-2020 年 5 月 13 日)、博时裕瑞纯债债券 |
|--|--|--|--|--|--|

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | 型证券投资基金(2019 年 3 月 11 日-2020 年 5 月 13 日)的基金经理。现任公司董事总经理兼固定收益总部公募基金组负责人、博时双月薪定期支付债券型证券投资基金(2013 年 10 月 22 日—至今)、博时安康 18 个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)(2017 年 2 月 17 日—至今)、博时富益纯债债券型证券投资基金(2018 年 5 月 9 日—至今)、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 11 月 22 日—至今)、博时富乐纯债债券型证券投资基金(2019 年 9 月 17 日—至今)、博时富添纯债债券型证券投资基金(2019 年 11 月 20 日—至今)、博时富信纯债债券型证券投资基金(2020 年 3 月 5 日—至今)、博时信用债纯债债券型证券投资基金(2020 年 3 月 11 日—至今)、博时稳定价值债券投资基金(2020 年 7 月 23 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 公平交易专项说明

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 9 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年 4 季度，债市整体收益率先上后下，10Y 国债收益率从 3.05% 最高上至 3.35%，后又回落到 3.1% 附近；1Y 国股行存单收益率从 9 月初的 2.95% 冲高至 3.3%，到年末又回落至 2.8%。四季度上半旬收益率走高主要是由于货币政策边际收紧，及 10 月中下旬“永煤”超预期违约打破了“国企信仰”造成了信用市场的恐慌，某些行业及某些地区受到连带影响，收益率大幅上行，叠加赎回压力，市场整体抛压较重，债券市场收益率整体冲高。11 月下旬到 12 月，信用市场逐步修复，央行对资金面也较为呵护加大了对市场的投放力度，基本面方面并无新增利空，12 月制造业 PMI 数据小幅回落，但仍处在复苏进程中，政策方面中央经济工作会议也强调政策不急转弯，叠加新冠疫情病毒变异等，短期不确定性增加，利率债各期限都有不同幅度的下行。

2021 年 1 季度，资金利率预计较 12 月份波动加大，债券市场仍处在区间震荡走势，难言趋势反转，需要关注几个扰动因素：1、资金面的扰动；2、权益市场的“春节躁动”行情的扰动；3、利率债供给提前。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 1.0269 元，份额累计净值为 1.1685 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 0.97%，同期业绩基准增长率为 1.17%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 4,942,673,000.00 | 97.51 |
| | 其中：债券 | 4,942,673,000.00 | 97.51 |
| | 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 | 59,945,209.92 | 1.18 |
| | 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 | 5,549,329.71 | 0.11 |
| 8 | 其他各项资产 | 60,977,415.22 | 1.20 |
| 9 | 合计 | 5,069,144,954.85 | 100.00 |

5.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 4,117,143,000.00 | 81.25 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,458,446,000.00 | 28.78 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 825,530,000.00 | 16.29 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 4,942,673,000.00 | 97.54 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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

| | | | | | |
|---|---------|--------------|-----------|----------------|------|
| 1 | 1928034 | 19 交通银行 01 | 4,900,000 | 490,735,000.00 | 9.68 |
| 2 | 200210 | 20 国开 10 | 4,000,000 | 383,600,000.00 | 7.57 |
| 3 | 180208 | 18 国开 08 | 3,700,000 | 371,813,000.00 | 7.34 |
| 4 | 1928017 | 19 兴业绿色金融 01 | 2,800,000 | 282,128,000.00 | 5.57 |
| 5 | 1920045 | 19 杭州银行债 | 2,400,000 | 241,512,000.00 | 4.77 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除 19 交通银行 01(1928034)、20 国开 10(200210)、18 国开 08(180208)、19 兴业绿色金融 01(1928017)、19 杭州银行债(1920045)、18 民生银行 01(1828016)、19 宁波银行小微债 01(1920047)、19 浙商银行绿色金融(1928027)、20 兴业银行小微债 03(2028020)、20 江苏银行 CD105(112014105)的发行主体外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

主要违规事实：2020 年 5 月 9 日，因交通银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在理财产品数据漏报、资金交易信息漏报严重等违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020 年 4 月 24 日，因存在 1.向“四证”不全的房地产项目发放贷款；2.未审核信贷资金是否按约定用途使用；3.贷款五级分类不准确等违规行为，中国银行保险监督管理委员会海南监管局对国家开发银行海南省分行处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020 年 6 月 12 日，因存在 1.为非法交易平台提供条码支付服务；2.为无证机构经营支付业务提供条码支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中一致性的规定等违规行为，中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司三明分行处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020 年 1 月 23 日，因存在虚增存贷款、个人经营性贷款管理不审慎等违规行为，中国银行保险监督管理委员会浙江监管局对杭州银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020年2月14日，因存在未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告等违规行为，中国人民银行对中国民生银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020年10月27日，因存在授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位的违规行为，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对宁波银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020年1月10日，因存在未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料及交易记录、未按规定进行可疑交易报告等违规行为，中国人民银行杭州市中心支行对浙商银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020年12月31日，因存在 1.个人贷款资金用途管控不严；2.发放流动资金贷款偿还银行承兑汇票垫款；3.理财投资和同业投资非标准化债权资产未严格比照自营贷款管理；4.个人理财资金对接项目资本金等违规行为，中国银行保险监督管理委员会江苏监管局对江苏银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

5.11.2 报告期内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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 60,977,415.22 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 60,977,415.22 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,934,259,198.24 |
| 报告期基金总申购份额 | - |

| | |
|--------------|------------------|
| 减：报告期基金总赎回份额 | 31,405.10 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金总份额 | 4,934,227,793.14 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | |
|--------------------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 9,546,539.38 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 9,546,539.38 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.19 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 报告期末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 | 9,546,539.38 | 0.19% | 9,546,539.38 | 0.19% | 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 | 9,546,539.38 | 0.19% | 9,546,539.38 | 0.19% | - |

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|-----|----------------|------------|
|-----|----------------|------------|

| 类别 | 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 | 2020-10-01~2020-12-31 | 4,924,652,713.48 | - | - | 4,924,652,713.48 | 99.81% |
| 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> | | | | | | | |

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

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 12 月 31 日，博时基金公司共管理 246 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 13294 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 4012 亿元人民币，累计分红逾 1373 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。

其他大事件

2020 年 12 月 31 日，在中国证券业协会主办，中国期货业协会、中国证券投资基金业协会协办的第七届证券期货科学技术奖中，博时基金、金证财富《新一代投资决策支持系统》荣获证券期货科学技术奖三等奖。

2020 年 12 月，大众证券报“2020 中国基金风云榜”揭晓，博时基金获“2020 年度十大风云基金公司”，博时医疗保健行业获“2020 年度十大风云基金产品”。

2020 年 12 月 23 日，在信息时报“金狮奖”中，博时基金荣获“年度最具核心竞争力基金公司”。

2020 年 12 月 15 日，“聚中国 投未来·2021 新财富资产管理年会”在深圳举办，博时基金荣获 2020 新财富最智慧投资机构。

2020 年 12 月 11 日，由证券时报·券商中国主办的“2020 中国金融科技先锋榜”隆重揭晓，博时基金荣登“中国公募基金智能投研先锋榜”。

2020 年 12 月 10 日，金融界“第五届智能金融国际论坛暨 2020 金融界领航中国年度盛典”，博时基金荣获四项大奖。博时基金董事长江向阳获“杰出年度基金领袖奖”，博时基金荣获“杰出年度创新基金公司奖”、“杰出年度基金公司奖”、“杰出年度海外投资基金公司奖”。

2020 年 12 月 10 日，香港中资基金业协会（HKCAMA）和彭博（Bloomberg）2020 年度“离岸中资基金大奖”中，博时国际荣膺“最佳跨境业务”大奖，“博时-东方红大中华债券基金”荣膺“最佳总回报-大中华区固定收益（1 年）”亚军。

2020 年 12 月 8 日，北京商报社主办的“数字金融 争渡未来·2020 年度北京金融论坛”在北京举办，博时基金荣获 2020 年度北京金融业十大品牌·产品创新卓越奖。

2020 年 12 月 2 日，经济观察报举办的 2020 卓越金融企业盛典举行，博时基金荣获“年度卓越综合实力基金公司”称号。

2020 年 11 月 28 日，由 21 世纪经济报道主办的第五届财经“金帆奖”评选中，博时基金荣获“2020 年度卓越基金管理公司”。

2020 年 11 月 27 日，国际金融报“第三届 CSR 先锋论坛暨 2020 先锋奖项颁奖典礼”在北京举办，凭借在社会责任方面的贡献，博时基金荣获 2020 年度社会责任先锋案例。

2020 年 11 月 20 日，2020 第一财经金融价值榜·颁奖典礼在上海举办，博时基金获选“2020 年度第一财经金融价值榜”年度基金公司管理人。

2020 年 11 月 19 日，由思维财经&投资者网主办的思维财经投资者年会暨“金桥奖”颁奖盛典上，博时基金荣获“金桥奖·年度最具投资价值基金公司”。

2020 年 11 月，联合国负责任投资原则组织(UN PRI)发布 2020 年度签署方评估报告。博时基金在衡量公司整体 ESG 管理水平的“战略与治理”模块，获得了首批最高评价“A+”评定。

2020 年 10 月 28 日，由《中国基金报》主办的“2020 中国机构投资者峰会”在上海浦东香格里拉酒店举行。第七届中国基金业英华奖中，博时基金陈凯杨荣获“五年期纯债投资最佳基金经理”，过均荣获“五年期二级债投资最佳基金经理”，何凯荣获“三年期海外固收投资最佳基金经理”及“五年期海外固收投资最佳基金经理”。第二届中国公募基金英华奖中，博时基金荣获“2019 年度最佳营销策划案例（最佳创意）”、“2019 年度最佳社会公益实践案例”、“2019 年度最佳电商业务发展基金公司”、“2019 年度最佳创新基金产品”、“2019 年度最佳营销策划案例（最佳综合）”、“2019 年度最佳指数增强基金”奖项。

2020 年 10 月 23 日，国际金融报主办的“2020 国际先锋金融机构高峰论坛暨颁奖典礼”在上海举办，博时基金董事长江向阳荣获“金融行业先锋领袖”、博时基金荣获“先锋证券投资机构”。

2020 年 10 月 16 日，由《每日经济新闻》主办的“2020 中国金融每经峰会资本市场高峰论坛暨 2020 中国金鼎奖颁奖典礼”在上海举行，博时基金成功斩获“固收+最具人气基金公司奖”和“最具影响力基金公司-专户一对多”奖项，博时基金投资经理王晓冬荣获“最具实力权益类专户基金经理”奖项。

2020 年 9 月 22 日，由《投资时报》及标点财经研究院联合主办的“见未来·2020 第三届资本市场高峰论坛暨金禧奖年度颁奖盛典”在京举办，凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金荣获三项大奖。博时获评“金禧奖·2020 卓越公募基金公司”、“金禧奖·2020 优秀固收类基金团队”、“金禧奖·2020 大湾区特别贡献奖”。

2020 年 9 月 15 日，《上海证券报》第十七届“金基金”奖颁奖典礼在上海隆重举办，凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金及子公司博时资本共荣获三项大奖。博时基金荣获 2019 年度金基金·海外投资回报基金管理公司奖。博时旗下基金产品博时新起点灵活配置混合型证券投资基金获得 2019 年度金基金·灵活配置型基金三年期奖。博时资本张存相荣获“金阳光·三年卓越私募基金经理（MOM 类）”奖项。

2020 年 8 月 6 日，《经济观察报》“见圳四十年---深圳经济特区成立 40 周年特别盛典”在深圳举办，博时基金荣获“致敬深圳经济特区成立四十周年卓越企业”奖项。

2020 年 7 月 9 日，新浪财经“2020 中国基金业开放与发展高峰论坛暨基金业致敬资本市场 30 周年峰会”在云端举办，届时公布了 2020 中国基金业金麒麟奖，博时基金荣获“2020 十大风云基金公司”，此外，博时基金王俊荣获“2020 最受青睐股票基金经理”奖项，博时基金赵云阳、桂征辉、王祥均荣获“2020 最受青睐指数与 ETF 基金经理”奖项。

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”。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 10.1.1 中国证监会批准博时聚瑞纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金募集的文件
- 10.1.2 《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基金合同》
- 10.1.3 《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托管协议》
- 10.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 10.1.5 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各年度审计报告正本
- 10.1.6 报告期内在指定报刊上各项公告的原稿

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

10.3 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

二〇二一年一月二十二日