

**博时富盈一年定期开放债券型发起式证券
投资基金
2023 年第 3 季度报告
2023 年 9 月 30 日**

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：渤海银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

§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。

基金托管人渤海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 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 2023 年 7 月 20 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 博时富盈一年定开债发起式 |
| 基金主代码 | 017514 |
| 交易代码 | 017514 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 7 月 20 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,000,000,800.00 份 |
| 投资目标 | 在有效控制投资组合风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法，进行前瞻性的决策。一方面，本基金将分析众多的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等），并关注国家财政、税收、货币、汇率政策和其它证券市场政策等。另一方面，本基金将对债券市场整体收益率曲线变化进行深入细致分析，从而对市场走势和波动特征进行判断。在此基础上，确定资产在非信用类固定收益类证券（国家债券、中央银行票据等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例。本基金灵活应用期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、个券挖掘策略、信用衍生品投资策略、国债期货投资策略等投资策略，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>（二）开放期投资策略</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</p> |

| | |
|--------|---|
| | 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。 |
| 基金管理人 | 博时基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 渤海银行股份有限公司 |

§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 (2023 年 7 月 20 日（基金合同生效日）-2023 年 9 月 30 日) |
|----------------|---|
| 1.本期已实现收益 | 5,811,651.97 |
| 2.本期利润 | -94,855.18 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0000 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,999,905,944.82 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0000 |

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（不包含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

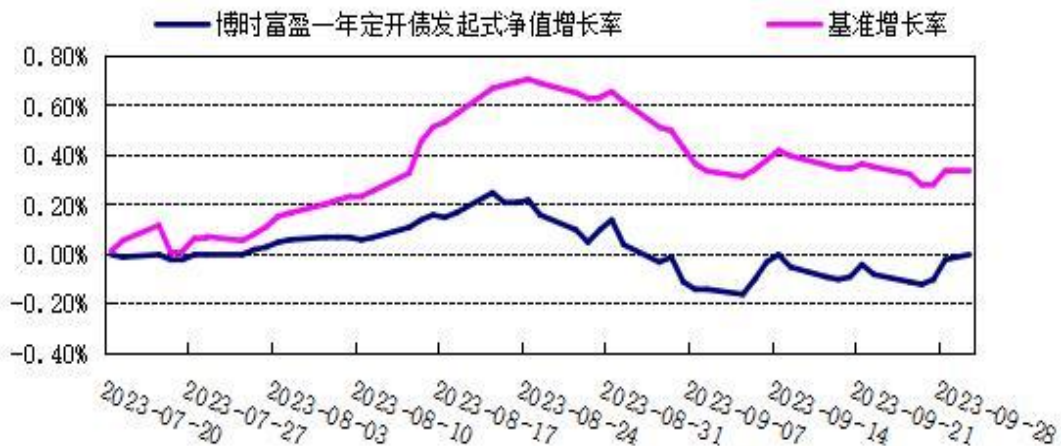
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 自基金合同生 效起至今 | 0.00% | 0.04% | 0.34% | 0.04% | -0.34% | 0.00% |

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



注：本基金的基金合同于 2023 年 7 月 20 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 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。

§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 | | |
| 李更 | 基金经理 | 2023-07-20 | - | 9.2 | 李更先生，硕士。2014 年至 2015 年在华泰资产管理有限公司任交易员。2015 年加入博时基金管理有限公司。历任交易员、基金经理助理、博时富添纯债债券型证券投资基金(2022 年 3 月 30 日-2023 年 9 月 26 日)、博时现金宝货币市场基金(2022 年 3 月 30 日-2023 年 9 月 26 日)的基金经理。现任博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金(2022 年 3 月 30 日—至今)、博时合晶货币市场基金(2022 年 6 月 22 日—至今)、博时兴盛货币市场基金(2022 年 6 月 22 日—至今)、博时民丰纯债债券型证券投资基金(2023 年 5 月 31 日— |

| | | | | | |
|----|------|------------|---|------|--|
| | | | | | 至今)、博时富耀纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2023 年 6 月 21 日—至今)、博时富盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2023 年 7 月 20 日—至今)、博时外服货币市场基金(2023 年 9 月 12 日—至今)、博时合鑫货币市场基金(2023 年 9 月 12 日—至今)的基金经理,博时安弘一年定期开放债券型发起式证券投资基金、博时合惠货币市场基金、博时富瑞纯债债券型证券投资基金、博时现金收益证券投资基金的基金经理助理。 |
| 程卓 | 基金经理 | 2023-08-02 | - | 11.1 | 程卓先生,硕士。2008 年起先后在招商银行总行、诺安基金工作。2017 年加入博时基金管理有限公司。历任博时安恒 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2018 年 4 月 2 日-2018 年 6 月 16 日)、博时安诚 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2018 年 5 月 28 日-2019 年 1 月 23 日)、博时聚源纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日-2019 年 3 月 19 日)、博时汇享纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日-2019 年 3 月 19 日)、博时安祺一年定期开放债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日-2019 年 8 月 22 日)、博时富宁纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日-2021 年 2 月 5 日)、博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 4 月 23 日-2021 年 2 月 5 日)、博时富永纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>(2018 年 12 月 19 日-2021 年 2 月 5 日)、博时裕嘉纯债 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-2021 年 2 月 5 日)、博时悦楚纯债债券型证券投资基金(2019 年 6 月 4 日-2021 年 2 月 5 日)、博时富元纯债债券型证券投资基金(2019 年 2 月 25 日-2022 年 3 月 16 日)、博时安丰 18 个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)(2018 年 4 月 23 日-2022 年 9 月 9 日)、博时民泽纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日-2023 年 7 月 26 日)的基金经理。现任博时安誉 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日—至今)、博时景兴纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日—至今)、博时臻选纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日—至今)、博时智臻纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日—至今)、博时富嘉纯债债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日—至今)、博时安泰 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2018 年 3 月 15 日—至今)、博时安诚 3 个月定期开放债券型证券投资基金(2019 年 1 月 23 日—至今)、博时富诚纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日—至今)、博时裕盈纯债 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)、博时裕顺纯债债券型证券投资基金(2019 年 8 月 19 日—至今)、博时安祺 6 个月定期开放债券型证券投资基金</p> |
|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | (2019 年 8 月 22 日—至今)、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金(2020 年 6 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(2022 年 3 月 31 日—至今)、博时富盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2023 年 8 月 2 日—至今)的基金经理, 博时聚源纯债债券型证券投资基金、博时富恒纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、博时富璟纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。 |
|--|--|--|--|--|--|

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 61 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

三季度, 债券收益率先抑后扬, 整体震荡上行, 出现一定幅度调整。前半段, 债市更多围绕稳增长政

策预期进行博弈。7 月政治局会议删除“房住不炒”，强调“活跃资本市场”，政策基调明确转向，但政策效果还需要等待一定时间，因此，债市收益率在 7 月下旬冲出高点后，缓步回落，并在 8 月降息加持下，下行至本轮低点，10 年国债 2.53%。货币宽松政策落地后，稳增长政策开始加快出台，尤其是 8 月底一系列刺激地产消费的政策密集推出，叠加资金超预期收紧，债券收益率开启上行，10 年国债到季末回到 2.7% 附近，短端上行幅度更大，国债 10-1 年利差压缩至 50bp 左右，曲线熊平。

展望后市，四季度债市确实面临一些不利因素。首先，稳增长政策持续发力后，四季度进入政策效果的观察期，短期可能看到向好的基本面数据，对债市形成一定压制。其次，四季度债券供给上可能维持一定强度，国债及一般地方债已在 3 季度加速发行，后续特殊再融资债可能将接续发行，节奏尚待观察。最后，汇率持续承压，可能也会对资金面形成一定制约。

当然，从中长期维度看，广谱利率仍处下行趋势中，存贷款利率等均处于历史极低位，在此背景下，债券利率上行空间有限。且从绝对收益率角度看，10 年国债高于 mlf 20bp，对于政策刺激下基本面的短期复苏已经有一定定价，短端 cd 也已上行到 mlf 附近，充分反应了资金中枢可能在供给放量及信贷修复影响下有所上行的预期。另外，货币政策尽管受到汇率制约，但“以我为主”的基调未变，对流动性仍是偏呵护态度，这对债市仍是重要支撑。因此，拉长周期看，短期的调整应是配置债券的较好时点。

组合操作上，本组合将继续遵循稳健投资理念，投资策略上积极主动，投资思路上开放灵活，维持灵活久期、适度杠杆、优质债券配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 09 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.0000 元，份额累计净值为 1.0000 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 0.00%，同期业绩基准增长率为 0.34%。

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 | 1,977,036,863.76 | 98.82 |
| | 其中：债券 | 1,977,036,863.76 | 98.82 |
| | 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 | 13,007,747.20 | 0.65 |
| | 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 | 10,028,067.23 | 0.50 |
| 8 | 其他各项资产 | 584,075.30 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 2,000,656,753.49 | 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 | 748,900,679.12 | 37.45 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,044,756,442.10 | 52.24 |
| | 其中：政策性金融债 | 801,743,681.14 | 40.09 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 71,837,283.06 | 3.59 |
| 6 | 中期票据 | 111,542,459.48 | 5.58 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,977,036,863.76 | 98.86 |

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 | 230203 | 23 国开 03 | 2,500,000 | 256,642,739.73 | 12.83 |
| 2 | 019704 | 23 国债 11 | 2,253,000 | 227,138,201.09 | 11.36 |
| 3 | 019696 | 23 国债 03 | 2,200,000 | 223,864,646.57 | 11.19 |
| 4 | 210203 | 21 国开 03 | 1,100,000 | 114,423,622.95 | 5.72 |
| 5 | 150218 | 15 国开 18 | 1,000,000 | 102,764,590.16 | 5.14 |

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会湖北监管局、国家金融监督管理总局山西监管局、国家金融监督管理总局浙江监管局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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 | 584,075.30 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |

| | | |
|---|-------|------------|
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 584,075.30 |

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

| | |
|-------------------------|------------------|
| 基金合同生效日基金份额总额 | 2,000,000,800.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | - |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 2,000,000,800.00 |

§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

| | |
|--------------------------|---------------|
| 基金合同生效日管理人持有的本基金份额 | 10,000,900.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 10,000,900.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.50 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额（份） | 交易金额（元） | 适用费率 |
|----|------|------------|---------------|---------------|-------|
| 1 | 认购 | 2023-07-20 | 10,000,900.00 | 10,001,000.00 | 0.00% |

| | | | | | |
|----|--|--|---------------|---------------|--|
| 合计 | | | 10,000,900.00 | 10,001,000.00 | |
|----|--|--|---------------|---------------|--|

注：适用费率为四舍五入后的结果。

§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 | 10,000,900.00 | 0.50% | 10,000,900.00 | 0.50% | 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 | 10,000,900.00 | 0.50% | 10,000,900.00 | 0.50% | - |

§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

无。

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 2023 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理 356 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 14570 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5106 亿元人民币，累计分红逾 1884 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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时富盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件
- 2、《博时富盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《博时富盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、报告期内博时富盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金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询，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
二〇二三年十月二十五日