

博时亚洲票息收益债券型证券投资基金
2021 年中期报告
2021 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

§ 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 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 境外投资顾问和境外资产托管人 | 5 |
| 2.5 信息披露方式 | 5 |
| 2.6 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 | 6 |
| §4 管理人报告 | 6 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 6 |
| 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 | 7 |
| 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 7 |
| 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 7 |
| 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 8 |
| 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 8 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 8 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 9 |
| 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 | 9 |
| §5 托管人报告 | 9 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 9 |
| 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 | 9 |
| 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 | 9 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 9 |
| 6.1 资产负债表 | 10 |
| 6.2 利润表 | 11 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 11 |
| 6.4 报表附注 | 12 |
| §7 投资组合报告 | 26 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 26 |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 | 27 |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合 | 27 |
| 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 | 27 |
| 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动 | 27 |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 | 27 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 | 27 |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 | 27 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 | 27 |
| 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 | 28 |
| 7.11 投资组合报告附注 | 28 |
| §8 基金份额持有人信息 | 29 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 29 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 29 |
| 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 | 29 |

| | |
|--|-----------|
| § 9 开放式基金份额变动 | 29 |
| § 10 重大事件揭示 | 29 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 29 |
| 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 | 30 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 30 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 30 |
| 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 | 30 |
| 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 | 30 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 30 |
| 10.8 其他重大事件 | 31 |
| § 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 | 33 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 33 |
| § 12 备查文件目录 | 33 |
| 12.1 备查文件目录 | 33 |
| 12.2 存放地点 | 33 |
| 12.3 查阅方式 | 33 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金名称 | 博时亚洲票息收益债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 博时亚洲票息收益债券 |
| 基金主代码 | 050030 |
| 交易代码 | 050030 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013 年 2 月 1 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 | 2,509,102,671.98 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金通过分析亚洲区域各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面，寻找各类债券的投资机会，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。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取资产配置策略、债券投资策略、基金投资策略和金融衍生品投资策略。资产配置策略指本基金密切跟踪相关国家或地区经济的景气周期以及财政、货币政策变化，把握市场利率水平的运行态势，从宏观层面了解亚洲各国家、行业的景气情况、防范系统性的宏观经济、政治以及信用风险，从而确定基金资产在不同国家、不同行业以及不同债券品种之间的配置比例。债券投资策略主要是指买入持有策略和信用策略。基金投资策略主要是指本基金投资债券基金等固定收益类基金。金融衍生品投资策略是指本基金主要投资于在经中国证监会认可的交易所上市交易的金融衍生品，当这些交易所没有本基金需要的衍生产品时，在严格风险控制的前提下，本基金将采用场外交易市场（OTC）买卖衍生产品。 |
| 业绩比较基准 | JPMorganAsianCreditIndexCompositeTotalReturn |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型基金，主要投资于亚洲市场的各类债券，预期收益和风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中等风险/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 | | 江向阳 | 缪建民 |

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | | 境外投资顾问 | 境外资产托管人 |
|------|----|--------|---------------------------------|
| 名称 | 英文 | - | Brown Brothers Harriman Co. |
| | 中文 | - | 布朗兄弟哈里曼银行 |
| 注册地址 | | - | 140 Broadway New York, NY 10005 |
| 办公地址 | | - | 140 Broadway New York, NY 10005 |
| 邮政编码 | | - | - |

注：本基金未聘请境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

| | |
|---------------------|-----------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报 |
| 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 |

2.6 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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 43,444,318.70 |
| 本期利润 | -58,758,259.49 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0236 |
| 本期加权平均净值利润率 | -1.59% |
| 本期基金份额净值增长率 | -1.57% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 1,106,461,761.87 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.4410 |
| 期末基金资产净值 | 3,686,218,003.12 |
| 期末基金份额净值 | 1.4691 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 67.56% |

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.77% | 0.19% | 1.88% | 0.21% | -1.11% | -0.02% |
| 过去三个月 | -1.38% | 0.20% | -0.65% | 0.24% | -0.73% | -0.04% |
| 过去六个月 | -1.57% | 0.30% | -1.11% | 0.27% | -0.46% | 0.03% |
| 过去一年 | -1.58% | 0.30% | -5.23% | 0.27% | 3.65% | 0.03% |
| 过去三年 | 18.42% | 0.30% | 17.56% | 0.28% | 0.86% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 67.56% | 0.26% | 49.18% | 0.26% | 18.38% | 0.00% |

注：本基金的业绩比较基准为：JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return

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



§ 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 2021 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 276 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 15482 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 4383 亿元人民币，累计分红逾 1465 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。

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 | | |
| 何凯 | 固定收益 总部国际 组负责人、 投资总监/ 基金经理 | 2014-04-02 | - | 14.8 | 何凯先生，双硕士。CFA，2006年起先后在荷兰银行（伦敦），中国投资有限责任公司、南方东英资产管理有限公司从事投资研究工作。2012年12月加入博时基金管理有限公司。历任国际投资部副总经理、国际投资部副总经理兼基金经理助理、固定收益总部国际组投资副总监兼基金经理助理、固定收益总部国际组投资副总监。现任固定收益总部国际组负责人、投资总监兼博时亚洲票息收益债券型证券投资基金(2014年4月2日一至今)的基金经理。 |

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.4.3 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 24 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，美债利率在一季度创出年内高点后逐步回落，风险资产总体呈上行趋势。分段来看：一季度，随着疫苗逐渐开始普及和美国财政刺激加码，进一步强化了经济复苏和通胀预期，以美国为首的发达市场长期国债利率显著上升，美债 10 年期利率上行超 80bp，风险资产中跟经济复苏相关性较大的板块涨幅较大，而前期更加受益于疫情的资产则冲高回落。二季度，在通胀预期已被充分定价，经济数据超预期程度逐渐减弱，美联储对通胀开始关注，市场新增空头力量不足等多重因素影响下，美国长期国债利率高位回落，10 年期利率下行近 30bp。同时，在天量流动性的驱动下，信用、股票、大宗商品等风险资产均表现良好。

亚洲债券市场一方面得到流动性宽松的支撑，另一方面又受利率上行的拖累，总体表现平稳。从评级上看，高收益债券表现优于投资级；从区域上看，斯里兰卡、蒙古、巴基斯坦表现最强；马尔代夫、马来西亚、中国台湾表现最弱。

在基金的操作上，我们总体维持了中短久期高收益债为核心的配置策略，但在二季度适当拉长了久期，增持了投资级债券和可转债，组合表现略弱于基准。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.4691 元，份额累计净值为 1.6116 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-1.57%，同期业绩基准增长率-1.11%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为即使考虑到美联储可能缩量宽松，基于美联储对通胀的容忍和其史无前例的资产负债表规模，全球流动性仍将维持充裕，此外美国长期国债利率上行动力仍然不足，且可能存在进一步下行的催化剂，如经济复苏动力衰退，通胀交易退潮等，整体而言流动性和利率环境将有利于债市表现。但信用方面市场或进一步分化，总体仍需严防信用风险，在此基础上可适当考虑困境反转的交易性机会。

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公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、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

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遵规守信、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。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时亚洲票息收益债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | - | - |
| 银行存款 | 6.4.3.1 | 245,490,414.89 | 315,074,176.17 |
| 结算备付金 | | 59,535,127.48 | 36,183,645.88 |
| 存出保证金 | | 12,100,000.00 | 40,025,591.15 |
| 交易性金融资产 | 6.4.3.2 | 3,390,125,998.66 | 2,729,577,155.61 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | 141,902,556.60 | 130,250,053.80 |
| 债券投资 | | 3,248,223,442.06 | 2,599,327,101.81 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 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 | 45,652,183.28 | 42,275,378.05 |
| 应收股利 | | - | 455,229.22 |
| 应收申购款 | | 7,724,367.04 | 17,708,335.88 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.3.6 | - | - |
| 资产总计 | | 3,760,628,091.35 | 3,181,299,511.96 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 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 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 14,455,366.41 | - |
| 应付赎回款 | | 55,865,109.78 | 9,865,374.25 |
| 应付管理人报酬 | | 2,430,320.45 | 2,046,511.65 |
| 应付托管费 | | 759,475.16 | 639,534.89 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.3.7 | - | - |
| 应交税费 | | 637,132.02 | 1,494,563.39 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.3.8 | 262,684.41 | 228,325.26 |
| 负债合计 | | 74,410,088.23 | 14,274,309.44 |
| 所有者权益： | | - | - |
| 实收基金 | 6.4.3.9 | 2,509,102,671.98 | 2,121,975,574.94 |
| 未分配利润 | 6.4.3.10 | 1,177,115,331.14 | 1,045,049,627.58 |
| 所有者权益合计 | | 3,686,218,003.12 | 3,167,025,202.52 |

| | | | |
|------------|--|------------------|------------------|
| 负债和所有者权益总计 | | 3,760,628,091.35 | 3,181,299,511.96 |
|------------|--|------------------|------------------|

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值为 1.4691 元，基金份额总额为 2,509,102,671.98 份。

6.2 利润表

会计主体：博时亚洲票息收益债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | -38,583,962.91 | 74,072,311.10 |
| 1. 利息收入 | | 77,836,372.48 | 65,009,607.19 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.3.11 | -219,428.63 | 100,269.75 |
| 债券利息收入 | | 78,055,801.11 | 64,909,337.44 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -15,787,668.26 | 17,264,570.96 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.3.12 | - | - |
| 基金投资收益 | 6.4.3.13 | -4,759,034.79 | -1,586,625.28 |
| 债券投资收益 | 6.4.3.14 | -39,025,282.88 | 26,493,407.60 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.3.15 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.3.16 | 26,012,022.08 | -7,642,211.36 |
| 股利收益 | 6.4.3.17 | 1,984,627.33 | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.3.18 | -102,202,578.19 | -17,377,209.90 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | -1,588,811.69 | 3,839,514.70 |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.3.19 | 3,158,722.75 | 5,335,828.15 |
| 减：二、费用 | | 20,174,296.58 | 13,531,310.23 |
| 1. 管理人报酬 | | 14,632,283.10 | 9,904,772.25 |
| 2. 托管费 | | 4,572,588.52 | 3,095,241.28 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.3.20 | 504,096.79 | 187,275.49 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | 357,511.81 | 233,673.63 |
| 7. 其他费用 | 6.4.3.21 | 107,816.36 | 110,347.58 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -58,758,259.49 | 60,541,000.87 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -58,758,259.49 | 60,541,000.87 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时亚洲票息收益债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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） | 2,121,975,574.94 | 1,045,049,627.58 | 3,167,025,202.52 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -58,758,259.49 | -58,758,259.49 |
| 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） | 387,127,097.04 | 190,823,963.05 | 577,951,060.09 |
| 其中：1. 基金申购款 | 717,004,426.45 | 348,639,414.28 | 1,065,643,840.73 |
| 2. 基金赎回款 | -329,877,329.41 | -157,815,451.23 | -487,692,780.64 |
| 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） | 2,509,102,671.98 | 1,177,115,331.14 | 3,686,218,003.12 |
| 项目 | 上年度可比期间 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） | 1,822,635,211.27 | 835,771,932.58 | 2,658,407,143.85 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 60,541,000.87 | 60,541,000.87 |
| 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） | -96,395,983.45 | -45,709,605.04 | -142,105,588.49 |
| 其中：1. 基金申购款 | 526,249,427.74 | 221,449,279.07 | 747,698,706.81 |
| 2. 基金赎回款 | -622,645,411.19 | -267,158,884.11 | -889,804,295.30 |
| 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） | 1,726,239,227.82 | 850,603,328.41 | 2,576,842,556.23 |

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：孙献

会计机构负责人：倡方方

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产

进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、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。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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

6.4.3 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 2021 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 245,490,414.89 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 245,490,414.89 |

注：于 2021 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为美元 32,441,019.83 元（折合人民币 209,572,232.21 元），港币 11,701,162.93 元（折合人民币 9,736,303.65 元），欧元 1,600,043.24 元（折合人民币 12,298,252.35 元）。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | | | |
|--------|------------------------|------------------|------------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | |
| | 柜台交易市场 | 3,347,491,263.95 | 3,248,223,442.06 | -99,267,821.89 |
| | 合计 | 3,347,491,263.95 | 3,248,223,442.06 | -99,267,821.89 |
| 资产支持证券 | - | - | - | |
| 基金 | 147,405,195.57 | 141,902,556.60 | -5,502,638.97 | |

| | | | |
|----|------------------|------------------|-----------------|
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 3,494,896,459.52 | 3,390,125,998.66 | -104,770,460.86 |

注：柜台交易市场债券参照做市商或其他权威价格提供机构的报价估值。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 | | | 备注 |
|--------|-------------------|------|----|----|
| | 合同/名义 金额 | 公允价值 | | |
| | | 资产 | 负债 | |
| 利率衍生工具 | - | - | - | - |
| 货币衍生工具 | - | - | - | - |
| 汇率期货 | 641,844,970.00 | - | - | - |
| 权益衍生工具 | - | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | 641,844,970.00 | - | - | - |

注：衍生金融资产项下的货币衍生工具为汇率期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持汇率期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的汇率期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

于2021年6月30日，本基金持有的汇率期货合约情况如下：

| 代码 | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值 | 公允价值变动 |
|------------|---------------|-----------|----------------|---------------|
| XUCU1 | USD/CNH Sep21 | -1,000.00 | 649,250,000.00 | -7,405,030.00 |
| 总额合计 | | | | -7,405,030.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 | - | - | - | -7,405,030.00 |
| 期货投资净额 | - | - | - | - |

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.3.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,647.66 |
| 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 | 45,650,535.62 |
| 应收债券利息 | - |
| 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 | - |
| 合计 | 45,652,183.28 |

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 应付交易费用

无余额。

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 158,546.06 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 104,138.35 |
| 合计 | 262,684.41 |

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 2,121,975,574.94 | 2,121,975,574.94 |
| 本期申购 | 717,004,426.45 | 717,004,426.45 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -329,877,329.41 | -329,877,329.41 |
| 本期末 | 2,509,102,671.98 | 2,509,102,671.98 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.3.10 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 | 899,924,582.55 | 145,125,045.03 | 1,045,049,627.58 |
| 本期利润 | 43,444,318.70 | -102,202,578.19 | -58,758,259.49 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 163,092,860.62 | 27,731,102.43 | 190,823,963.05 |
| 其中：基金申购款 | 306,353,326.48 | 42,286,087.80 | 348,639,414.28 |
| 基金赎回款 | -143,260,465.86 | -14,554,985.37 | -157,815,451.23 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,106,461,761.87 | 70,653,569.27 | 1,177,115,331.14 |

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | -120,379.95 |
| 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 | -99,441.25 |
| 其他 | 392.57 |
| 合计 | -219,428.63 |

注：活期存款和结算备付金负利息收入为境外托管行、期货券商对存款和备付金收取利息。

6.4.3.12 股票投资收益

无发生额。

6.4.3.13 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额 | 59,915,094.16 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 64,674,128.95 |
| 基金投资收益 | -4,759,034.79 |

6.4.3.14 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,848,294,114.73 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,871,490,183.88 |
| 减：应收利息总额 | 15,829,213.73 |
| 买卖债券差价收入 | -39,025,282.88 |

6.4.3.15 资产支持证券投资收益

无发生额。

6.4.3.16 衍生工具收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 期货投资收益 | 26,649,611.70 |
| 减：增值税抵减 | 637,589.62 |
| 合计 | 26,012,022.08 |

6.4.3.17 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | - |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | 1,984,627.33 |
| 合计 | 1,984,627.33 |

6.4.3.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -74,512,988.19 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | -67,808,943.32 |
| ——资产支持证券投资 | - |

| | |
|------------------------|-----------------|
| ——基金投资 | -6,704,044.87 |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | -27,689,590.00 |
| ——权证投资 | - |
| ——期货投资 | -27,689,590.00 |
| 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 | -102,202,578.19 |

6.4.3.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 3,158,722.75 |
| 合计 | 3,158,722.75 |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费的 75% 归基金资产。

2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中赎回费部分的 75% 归入转出基金的基金资产。

6.4.3.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 504,096.79 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 交易基金产生的费用 | - |
| 其中：申购费 | - |
| 赎回费 | - |
| 合计 | 504,096.79 |

6.4.3.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 44,630.98 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费用 | 3,678.01 |
| 合计 | 107,816.36 |

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

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

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、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、基金销售机构 |
| 布朗兄弟哈里曼银行(“布朗兄弟哈里曼”) | 境外资产托管人 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 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 2021年1月1日至2021年6月 30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 14,632,283.10 | 9,904,772.25 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,520,160.78 | 3,721,903.45 |

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月 30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,572,588.52 | 3,095,241.28 |

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

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

无。

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

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

无。

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

无。

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 | | 上年度可比期间 | |
|---------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | 2020年1月1日至2020年6月30日 | 2020年1月1日至2020年6月30日 | 2020年1月1日至2020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 |
| 招商银行 | 131,062,995.11 | 26,530.25 | 124,173,258.61 | 121,193.15 |
| 布朗兄弟哈里曼 | 114,427,419.78 | -146,910.20 | 87,984,822.71 | -10,984.28 |

注：本基金的银行存款分别由基金托管人招商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼保管，按适用利率或约定利率计息。负的利息收入主要由布朗兄弟哈里曼对港币、欧元收取的利息产生。

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

无。

6.4.8 期末（2021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 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 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

本基金属于债券型基金，主要投资于亚洲市场的各类债券，其预期收益及风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于中等风险/中等收益特征的开放式基金。本基金为主动式投资的债券型基金，本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过分析亚洲区域各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面，寻找各类债券的投资机会，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。

本基金的基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由执行总裁和风险控制委员会、督察长、监察法律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，在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；督察长独立行使权利，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；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察法律部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察法律部对公司执行总裁负责。

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，将风险控制可在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行招商银行及境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险不重大。在场外市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金投资于远期合约时，任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

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

本基金债券投资的信用评级情况按债券评级机构标准普尔公司设定的标准统计及汇总。

6.4.9.2.1 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 2021年6月30日 | 上年末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | 44,852,493.69 | - |
| 未评级 | 441,415,458.89 | - |
| 合计 | 486,267,952.58 | - |

注：评级机构为标准普尔。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

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 2021年6月30日 | 上年末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | 906,350,627.32 | 673,475,313.88 |
| 未评级 | 1,855,604,862.16 | 1,925,851,787.93 |
| 合计 | 2,761,955,489.48 | 2,599,327,101.81 |

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.3 流动性风险

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

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.8。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

6.4.9.4 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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。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 2021 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 | 245,490,414.89 | - | - | - | 245,490,414.89 |
| 结算备付金 | 59,535,127.48 | - | - | - | 59,535,127.48 |
| 存出保证金 | 12,100,000.00 | - | - | - | 12,100,000.00 |
| 交易性金融资产 | 486,267,952.58 | 1,707,393,393.03 | 1,054,562,096.45 | 141,902,556.60 | 3,390,125,998.66 |
| 应收利息 | - | - | - | 45,652,183.28 | 45,652,183.28 |
| 应收申购款 | - | - | - | 7,724,367.04 | 7,724,367.04 |
| 资产总计 | 803,393,494.95 | 1,707,393,393.03 | 1,054,562,096.45 | 195,279,106.92 | 3,760,628,091.35 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 55,865,109.78 | 55,865,109.78 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 14,455,366.41 | 14,455,366.41 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 2,430,320.45 | 2,430,320.45 |
| 应付托管费 | - | - | - | 759,475.16 | 759,475.16 |
| 应交税费 | - | - | - | 637,132.02 | 637,132.02 |

| | | | | | |
|--------------------------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|-----------------------|-------------------------|
| 其他负债 | - | - | - | 262,684.41 | 262,684.41 |
| 负债总计 | - | - | - | 74,410,088.23 | 74,410,088.23 |
| 利率敏感度缺口 | 803,393,494.95 | 1,707,393,393.03 | 1,054,562,096.45 | 120,869,018.69 | 3,686,218,003.12 |
| 上年度末 2020 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 | 101,158,837.33 | - | - | 213,915,338.84 | 315,074,176.17 |
| 结算备付金 | - | - | - | 36,183,645.88 | 36,183,645.88 |
| 存出保证金 | - | - | - | 40,025,591.15 | 40,025,591.15 |
| 交易性金融资产 | 181,535,137.82 | 1,704,247,638.87 | 713,544,325.12 | 130,250,053.80 | 2,729,577,155.61 |
| 应收股利 | - | - | - | 455,229.22 | 455,229.22 |
| 应收利息 | - | - | - | 42,275,378.05 | 42,275,378.05 |
| 应收申购款 | - | - | - | 17,708,335.88 | 17,708,335.88 |
| 资产总计 | 282,693,975.15 | 1,704,247,638.87 | 713,544,325.12 | 480,813,572.82 | 3,181,299,511.96 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 9,865,374.25 | 9,865,374.25 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 2,046,511.65 | 2,046,511.65 |
| 应付托管费 | - | - | - | 639,534.89 | 639,534.89 |
| 应交税费 | - | - | - | 1,494,563.39 | 1,494,563.39 |
| 其他负债 | - | - | - | 228,325.26 | 228,325.26 |
| 负债总计 | - | - | - | 14,274,309.44 | 14,274,309.44 |
| 利率敏感度缺口 | 282,693,975.15 | 1,704,247,638.87 | 713,544,325.12 | 466,539,263.38 | 3,167,025,202.52 |

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予以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|--------------------|----------------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元） | |
| | | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 增加约 2,734 | 增加约 1,876 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | 减少约 2,734 | 减少约 1,876 |

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控，并通过签署外汇远期合约的方式以达到规避外汇风险的目的。

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 | | | |
|----------|-------------------|---------------|---------------|------------------|
| | 美元 折合人民币 | 港币 折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 银行存款 | 209,572,232.21 | 9,736,303.65 | 12,298,252.35 | 231,606,788.21 |
| 结算备付金 | 5,379,197.94 | - | - | 5,379,197.94 |
| 交易性金融资产 | 3,254,755,502.25 | 81,218,380.22 | 34,009,936.19 | 3,369,983,818.66 |

| | | | | |
|---------------|---------------------|---------------|---------------|------------------|
| 应收利息 | 45,607,642.17 | 43,198.82 | - | 45,650,840.99 |
| 应收申购款 | 7,616,737.88 | - | - | 7,616,737.88 |
| 资产合计 | 3,522,931,312.45 | 90,997,882.69 | 46,308,188.54 | 3,660,237,383.68 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应付赎回款 | 54,349,660.47 | - | - | 54,349,660.47 |
| 应付清算款 | 2,622,845.82 | - | 11,832,520.59 | 14,455,366.41 |
| 其他负债 | 155,668.90 | - | - | 155,668.90 |
| 负债合计 | 57,128,175.19 | - | 11,832,520.59 | 68,960,695.78 |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 3,465,803,137.26 | 90,997,882.69 | 34,475,667.95 | 3,591,276,687.90 |
| 项目 | 上年度末 2020年12月31日 | | | |
| | 美元 折合人民币 | 港币 折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 银行存款 | 275,369,120.78 | - | - | 275,369,120.78 |
| 交易性金融资产 | 2,606,417,372.40 | 77,858,096.46 | 45,301,686.75 | 2,729,577,155.61 |
| 应收股利 | 455,229.22 | - | - | 455,229.22 |
| 应收利息 | 42,188,969.54 | 76,589.24 | - | 42,265,558.78 |
| 应收申购款 | 17,488,662.26 | - | - | 17,488,662.26 |
| 资产合计 | 2,941,919,354.20 | 77,934,685.70 | 45,301,686.75 | 3,065,155,726.65 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应付赎回款 | 5,039,768.42 | - | - | 5,039,768.42 |
| 负债合计 | 5,039,768.42 | - | - | 5,039,768.42 |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 2,936,879,585.78 | 77,934,685.70 | 45,301,686.75 | 3,060,115,958.23 |

6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|------------------|-------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 | |
| | | 影响金额（单位：人民币万元） | |
| | | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
| | 所有外币均相对人民币升值 5% | 增加约 17,956 | 增加约 15,301 |
| | 所有外币均相对人民币贬值 5% | 减少约 17,956 | 减少约 15,301 |

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于场外柜台交易的债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，密切跟踪相关国家或地区经济的景气周期以及财政、货币政策变化，把握市场利率水平的运行态势，从宏观层面了解亚洲各国家、行业的景气情况、防范系统性的宏观经济、政治以及信用风险，从而确定基金资产在不同国家、不同行业以及不同债券品种之间的配置比例。本基金采用的债券投资策略以买入持有策略为主，配合信用策略、期限结构策略、互换策略等卫星策略。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。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价

格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于亚洲市场债券的资产占债券资产的比例不低于 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的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，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | |
|--------------|------------------------|------------------|--------------------------|------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价 值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—基金投资 | 141,902,556.60 | 3.85 | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 141,902,556.60 | 3.85 | - | - |

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 141,902,556.60 元，属于第二层次的余额为 3,248,223,442.06 元，属于第三层次的余额为 0.00 元（上年度末：第一层次 130,250,053.80 元，第二层次 2,599,327,101.81 元，第三层次 0.00 元）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，

确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：普通股 | - | - |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 141,902,556.60 | 3.77 |
| 3 | 固定收益投资 | 3,248,223,442.06 | 86.37 |
| | 其中：债券 | 3,248,223,442.06 | 86.37 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 305,025,542.37 | 8.11 |
| 8 | 其他各项资产 | 65,476,550.32 | 1.74 |
| 9 | 合计 | 3,760,628,091.35 | 100.00 |

注：金融衍生品投资项下的期货投资，在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货结算暂收款（结算所得的持仓损益）相抵消后的净额为 0，具体投资情况详见报表附注 6.4.3.3。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期末未进行权益资产的投资。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 债券信用等级 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|------------|------------------|---------------|
| A+至 A- | 188,499,931.82 | 5.11 |
| BBB+至 BBB- | 229,464,250.75 | 6.22 |
| BB+至 BB- | 153,298,395.22 | 4.16 |
| B+至 B- | 379,940,543.22 | 10.31 |
| 未评级 | 2,297,020,321.05 | 62.31 |
| 合计 | 3,248,223,442.06 | 88.12 |

注：评级机构为标准普尔。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------------|-----------------------|--------|---------------|---------------|
| 1 | US48128DAC11 | JPM 0 1/8 01/01/23 | 80,000 | 57,819,445.42 | 1.57 |
| 2 | XS2228902255 | HPDLF 5.8 01/12/22 | 78,000 | 50,393,818.88 | 1.37 |
| 3 | XS2114327302 | YWSOAO 4 02/18/25 | 76,100 | 49,941,551.80 | 1.35 |
| 4 | XS2030333384 | PWRLNG 6.95 07/23/23 | 70,000 | 46,732,880.21 | 1.27 |
| 5 | XS1566179039 | NGERIA 7 7/8 02/16/32 | 60,000 | 41,855,246.30 | 1.14 |

注：债券代码为 ISIN 码。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 衍生品类别 | 衍生品名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-------|---------------|---------------|---------------|
| 1 | 期货 | USD/CNH Sep21 | -7,405,030.00 | -0.20 |

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------------------|------|------|----------------|----------------|---------------|
| 1 | VANECK JPM EM LOCAL CCY BOND | ETF | 开放式 | VanEck Vectors | 141,902,556.60 | 3.85 |

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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 | 12,100,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 45,652,183.28 |
| 5 | 应收申购款 | 7,724,367.04 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 65,476,550.32 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------------|-----------------------|---------------|---------------|
| 1 | XS1759625491 | POSEDF 0 02/01/25 | 41,146,314.93 | 1.12 |
| 2 | XS2038088527 | JPM 0 08/07/22 | 34,467,217.54 | 0.94 |
| 3 | XS1758433707 | KNBZMK 0 02/08/23 | 33,208,144.05 | 0.90 |
| 4 | XS2333569056 | MEITUA 0 04/27/28 | 28,100,142.98 | 0.76 |
| 5 | XS2284144339 | HSPGCL 0 01/22/26 | 24,347,600.09 | 0.66 |
| 6 | XS2045749798 | WUXIAP 0 09/17/24 | 23,223,348.89 | 0.63 |
| 7 | XS2112202101 | SINBIO 0 02/17/25 | 22,323,030.66 | 0.61 |
| 8 | XS1655583596 | SHPORT 0 08/09/22 | 21,189,838.61 | 0.57 |
| 9 | XS2269112863 | XIAOMI 0 12/17/27 | 20,906,498.63 | 0.57 |
| 10 | XS2158580493 | KINSF 0 5/8 04/29/25 | 14,534,607.02 | 0.39 |
| 11 | XS2089160506 | ANTSPL 0 02/05/25 | 11,686,905.53 | 0.32 |
| 12 | XS1914667057 | COGARD 4 1/2 12/05/23 | 10,842,967.61 | 0.29 |

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 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。

§ 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 |
| 24,317 | 103,183.07 | 943,470,423.64 | 37.60% | 1,565,632,248.34 | 62.40% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 1,128,739.38 | 0.04% |

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 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | - |

注：本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,121,975,574.94 |
| 本报告期基金总申购份额 | 717,004,426.45 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 329,877,329.41 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,509,102,671.98 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金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：基金管理人于 2021 年 2 月 6 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》，高阳先生担任公司总经理职务。

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 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普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行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 | | 基金交易 | |
|---------------------------------------|----------------|--------------|------|--------------|------|--------------|------|--------------|
| | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| Australia&New Zealand Bkg | 218,680,951.15 | 5.21% | - | - | - | - | - | - |
| BARCLAYS | 339,827,728.97 | 8.09% | - | - | - | - | - | - |
| BNP Paribas | 308,287,782.28 | 7.34% | - | - | - | - | - | - |
| BOC HK Branch | 115,700,875.42 | 2.76% | - | - | - | - | - | - |
| China Construction Bank International | 62,330,158.32 | 1.48% | - | - | - | - | - | - |
| China Everbright Bank Intl | 14,917,327.06 | 0.36% | - | - | - | - | - | - |
| China | 24,042,381.86 | 0.57% | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|---|----------------|--------|---|---|---|---|----------------|---------|
| International Capital Corporation | | | | | | | | |
| CITI Group | 476,668,150.25 | 11.35% | - | - | - | - | - | - |
| Credit Suisse | - | - | - | - | - | - | 142,964,243.27 | 100.00% |
| CITIC Securities | 44,552,949.66 | 1.06% | - | - | - | - | - | - |
| CMB International | 157,803,726.68 | 3.76% | - | - | - | - | - | - |
| CMB Wing Lung Bank | 8,335,077.00 | 0.20% | - | - | - | - | - | - |
| Deutsche Bank | 18,237,539.61 | 0.43% | - | - | - | - | - | - |
| Goldman Sachs | 193,184,282.33 | 4.60% | - | - | - | - | - | - |
| GTJA HongKong | 131,237,847.22 | 3.13% | - | - | - | - | - | - |
| Haitong International | 67,825,799.25 | 1.62% | - | - | - | - | - | - |
| HUATAI HK | 16,520,886.00 | 0.39% | - | - | - | - | - | - |
| ICBC Asia | 55,831,071.85 | 1.33% | - | - | - | - | - | - |
| JEFFERIES | 172,422,178.19 | 4.11% | - | - | - | - | - | - |
| JP MORGAN CHASE | 464,746,141.29 | 11.07% | - | - | - | - | - | - |
| Merrill Lynch | 82,359,266.66 | 1.96% | - | - | - | - | - | - |
| MIZUHO Securities | 193,050,207.76 | 4.60% | - | - | - | - | - | - |
| Morganstanley | 383,230,548.33 | 9.13% | - | - | - | - | - | - |
| NOMURA | 311,687,970.15 | 7.42% | - | - | - | - | - | - |
| Sc Lowy | 4,710,844.31 | 0.11% | - | - | - | - | - | - |
| Standard Chartered | 65,748,720.91 | 1.57% | - | - | - | - | - | - |
| The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited | 167,579,298.48 | 3.99% | - | - | - | - | - | - |
| Union Bank of Switzerland | 99,135,123.02 | 2.36% | - | - | - | - | - | - |

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，我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，在多家券商开立了券商交易账户。

1、基金券商交易账户的选择标准如下：

(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、个股分析的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、基金券商交易账户的选择程序如下：

(1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构；
 (2) 基金管理人在被选中的证券经营机构开立交易账户。

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 | 博时基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》及其细则修改 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露 | 2021-05-31 |

| | | | |
|----|---|---------------------------|------------|
| | 旗下基金法律文件的公告 | 露网站 | |
| 2 | 博时亚洲票息收益债券型证券投资基金基金合同 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2021-05-31 |
| 3 | 博时亚洲票息收益债券型证券投资基金托管协议 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2021-05-31 |
| 4 | 博时亚洲票息收益债券型证券投资基金更新招募说明书 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2021-05-31 |
| 5 | 博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通邮储银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2021-05-29 |
| 6 | 博时基金管理有限公司关于与上海银联电子支付服务有限公司合作开通华夏银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2021-05-26 |
| 7 | 博时基金管理有限公司关于暂停使用通联支付提供的交通银行、平安银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2021-04-28 |
| 8 | 博时基金管理有限公司关于暂停使用上海银联支付提供的兴业银行、广发银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2021-04-24 |
| 9 | 博时亚洲票息收益债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2021-04-22 |
| 10 | 关于博时亚洲票息收益债券基金参加招商银行申购及定投业务费率优惠活动的公告 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2021-04-16 |
| 11 | 关于博时旗下部分开放式基金增加贵州银行股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2021-04-02 |
| 12 | 博时亚洲票息收益债券型证券投资基金 2020 年年度报告 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2021-03-31 |
| 13 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2021-03-30 |
| 14 | 博时基金管理有限公司关于暂停使用富友支付提供的交通银行快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2021-03-20 |
| 15 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210310 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2021-03-10 |
| 16 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210220 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2021-02-20 |
| 17 | 博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2021-02-06 |
| 18 | 博时亚洲票息收益债券型证券投资基金 2020 | 中国证券报、基金管理人 | 2021-01-22 |

| | |
|-----------|----------------|
| 年第 4 季度报告 | 网站、证监会基金电子披露网站 |
|-----------|----------------|

§ 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时亚洲票息收益债券型证券投资基金设立的文件

12.1.2 《博时亚洲票息收益债券型证券投资基金基金合同》

12.1.3 《博时亚洲票息收益债券型证券投资基金托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.1.5 博时亚洲票息收益债券型证券投资基金各年度审计报告正本

12.1.6 报告期内博时亚洲票息收益债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，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
二〇二一年八月三十一日