

博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起  
式证券投资基金  
2023 年中期报告  
2023 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：二〇二三年八月三十一日

## § 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 2023 年 8 月 29 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
<b>§4 管理人报告</b>	<b>6</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
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	10
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
<b>§5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	11
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	39
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	40
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40

7.12 投资组合报告附注 .....	40
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
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.....	41
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	42
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>42</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变 .....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件 .....	44
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>45</b>
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.....	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	46
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>46</b>
12.1 备查文件目录 .....	46
12.2 存放地点 .....	47
12.3 查阅方式 .....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	博时聚利 3 个月定开债发起式
基金主代码	003259
交易代码	003259
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 18 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	4,156,769,787.12 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在一定程度上控制组合净值波动率的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<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，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。在以上战略性资产配置的基础上，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（现金、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。本基金采用的投资策略包括：期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、个券挖掘策略、资产支持证券投资策略、中小企业私募债投资策略、国债期货投资策略等。</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种。</p>
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率×90%+1 年期定期存款利率（税后）×10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	博时基金管理有限公司	招商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	孙麒清	张姗
	联系电话	0755-83169999	0755-83077987
	电子邮箱	service@bosera.com	zhangshan_1027@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 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
基金中期报告备置地点	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	北京市东城区建国门内大街8号中粮广场C座3层301

## § 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（2023年1月1日至2023年6月30日）
本期已实现收益	42,779,530.39
本期利润	72,747,544.44
加权平均基金份额本期利润	0.0218
本期加权平均净值利润率	2.15%
本期基金份额净值增长率	2.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	48,546,183.54
期末可供分配基金份额利润	0.0117
期末基金资产净值	4,228,131,773.60
期末基金份额净值	1.0172
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	28.33%

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。

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	0.31%	0.04%	0.39%	0.04%	-0.08%	0.00%
过去三个月	1.26%	0.03%	1.54%	0.03%	-0.28%	0.00%
过去六个月	2.20%	0.03%	2.45%	0.03%	-0.25%	0.00%
过去一年	3.07%	0.06%	3.86%	0.05%	-0.79%	0.01%
过去三年	10.93%	0.04%	11.35%	0.05%	-0.42%	-0.01%
自基金合同生效起至今	28.33%	0.04%	26.72%	0.06%	1.61%	-0.02%

#### 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 2023 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 355 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 14767 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 5220 亿元人民币，累计分红逾 1851 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		
李秋实	基金经理	2023-01-19	2023-02-22	10.9	李秋实女士，硕士。2012 年加入博时基金管理有限公司。历任固定收益研究助理、研究员、高级研究员、高级研究员兼基金经理助理、博时华盈纯债债券型证券投资基金(2020 年 7 月 7 日-2021 年 10 月 27 日)、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(2020 年 7 月 7 日-2021 年 10 月 27 日)、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(2020 年 7 月 7 日-2021 年 10 月 27 日)、博时民丰纯债债券型证券投资基金(2020 年 7 月 7 日-2021 年 10 月 27 日)、博时裕乾纯债债券型证券投资基金(2020 年 7 月 7 日-2021 年 10 月 27 日)、博时富添纯债债券型证券投资基金(2021 年 3 月 18 日-2022 年 3 月 30 日)、博时聚利纯债债券型证券投资基金(2021 年 8 月 17 日-2023 年 1 月 18 日)、博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2023 年 1 月 19 日-2023 年 2 月 22 日)、博时裕弘纯债债券型证券投资基金(2021 年 8 月 17 日-2023 年 3 月 23 日)的基金经理。现任博时富安纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2020 年 7 月 7



					日一至今)、博时富和纯债债券型证券投资基金(2020 年 7 月 7 日一至今)、博时裕腾纯债债券型证券投资基金(2020 年 7 月 7 日一至今)、博时富进纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2021 年 1 月 27 日一至今)、博时富洋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2021 年 1 月 27 日一至今)、博时富宁纯债债券型证券投资基金(2021 年 2 月 5 日一至今)、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(2021 年 2 月 5 日一至今)、博时富源纯债债券型证券投资基金(2021 年 2 月 25 日一至今)、博时裕泉纯债债券型证券投资基金(2021 年 10 月 27 日一至今)、博时裕瑞纯债债券型证券投资基金(2022 年 9 月 9 日一至今)的基金经理,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的基金经理助理。
王惟	基金经理	2023-02-22	-	14.9	王惟先生,硕士。2008 年起先后在博时基金、安信证券、博时基金工作。2008 年加入博时基金管理有限公司。历任产品设计师、年金投资部投资副总监、投资经理。2013 年再次加入博时基金管理有限公司。现任博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金(2022 年 1 月 4 日一至今)、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金(2022 年 1 月 4 日一至今)、博时裕景纯债债券型证券投资基金(2022 年 7 月 14 日一至今)、博时富通纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2022 年 7 月 14 日一至今)、博时华盈纯债债券型证券投资基金(2023 年 2 月 10 日一至今)、博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2023 年 2 月 22 日一至今)、博时裕弘纯债债券型证券投资基金(2023 年 3 月 23 日一至今)的基金经理,博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资

					基金、博时富盛纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、博时裕弘纯债债券型证券投资基金的基金经理助理。
王惟	基金经理助理	2023-01-19	2023-02-21	14.9	王惟先生，硕士。2008 年起先后在博时基金、安信证券、博时基金工作。2008 年加入博时基金管理有限公司。历任产品设计师、年金投资部投资副总监、投资经理。2013 年再次加入博时基金管理有限公司。现任博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金(2022 年 1 月 4 日一至今)、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金(2022 年 1 月 4 日一至今)、博时裕景纯债债券型证券投资基金(2022 年 7 月 14 日一至今)、博时富通纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2022 年 7 月 14 日一至今)、博时华盈纯债债券型证券投资基金(2023 年 2 月 10 日一至今)、博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2023 年 2 月 22 日一至今)、博时裕弘纯债债券型证券投资基金(2023 年 3 月 23 日一至今)的基金经理，博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、博时富盛纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、博时裕弘纯债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，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 89 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

2023 年上半年，国内投资者对国内经济的预期先扬后抑。先是疫情管控放开的变化激发了投资者对经济快速复苏的预期，并由此带动国内投资者的风险偏好上升。但当进入四月份之后，国内经济的各种高频数据陆续出现疲态，甚至出现了明显的下滑态势。对此，央行向下调整了 7 天回购、MLF 等短端利率，并指导各大银行下调各期限居民存款利率。国内债券市场从 3 月份开始收益率明显下行，呈现一个小牛市的状况，收益率曲线整体下行了 20BP 左右，短端利率下行幅度略大于长端。

操作方面，在坚持以票息策略为主的策略的基础上，根据市场变化进行了利率中长债的波段操作，力争增厚组合回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.0172 元，份额累计净值为 1.2620 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 2.20%，同期业绩基准增长率为 2.45%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下一阶段，在经过 7 月底的政治局经济定调后，将会迎来国内经济托底政策的密集出台，投资者对国内经济企稳上行的预期将会增强，在某些阶段债券的走势可能会有一定压力。不过，债券的中期走势仍取决于基本面，如果政策不及预期或海外衰退风险爆发，预计收益率还将有下行空间。

## 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。

#### 4.7 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 2023 年 3 月 9 日发布公告，以 2023 年 3 月 3 日可分配利润为基准，每 10 份基金份额发放红利 0.1540 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

托管人声明：

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。

本年度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

本年度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：博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,806,149.30	3,851,015.30
结算备付金		19,343,685.18	-
存出保证金		604.88	8,210.80
交易性金融资产	6.4.7.2	4,864,159,864.33	4,047,104,378.29
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,864,159,864.33	4,047,104,378.29
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.7.5	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	99.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,887,310,303.69	4,050,963,704.31
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2023年6月30日	2022年12月31日
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		657,255,742.05	855,149,033.56
应付清算款		116,559.59	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,016,443.88	811,148.83
应付托管费		338,814.63	270,382.94
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		260,340.86	206,085.19
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	190,629.08	313,552.93
负债合计		659,178,530.09	856,750,203.45
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	4,156,769,787.12	3,160,711,559.51
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.9	71,361,986.48	33,501,941.35
净资产合计		4,228,131,773.60	3,194,213,500.86
<b>负债和净资产总计</b>		<b>4,887,310,303.69</b>	<b>4,050,963,704.31</b>

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0172 元，基金份额总额 4,156,769,787.12 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		88,724,544.55	73,110,754.66
1. 利息收入		88,948.60	182,868.86
其中：存款利息收入	6.4.7.10	88,948.60	72,279.38
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	110,589.48
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		58,667,581.90	73,851,055.38
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	58,667,581.90	72,621,405.90
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	1,229,649.48
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	29,968,014.05	-923,169.58
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		15,977,000.11	17,242,667.96
1. 管理人报酬		5,018,066.21	4,849,279.03
2. 托管费		1,672,688.76	1,616,426.34
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		8,989,942.09	10,435,785.42
其中：卖出回购金融资产支出		8,989,942.09	10,435,785.42
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		156,280.04	199,903.34
8. 其他费用	6.4.7.19	140,023.01	141,273.83
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		72,747,544.44	55,868,086.70
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		72,747,544.44	55,868,086.70
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		72,747,544.44	55,868,086.70

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	3,160,711,559.51	-	33,501,941.35	3,194,213,500.86
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	3,160,711,559.51	-	33,501,941.35	3,194,213,500.86
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	996,058,227.61	-	37,860,045.13	1,033,918,272.74
(一)、综合收益总额	-	-	72,747,544.44	72,747,544.44
(二)、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)	996,058,227.61	-	13,939,404.75	1,009,997,632.36
其中: 1. 基金申购款	996,058,783.60	-	13,939,412.82	1,009,998,196.42
2. 基金赎回款	-555.99	-	-8.07	-564.06
(三)、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)	-	-	-48,826,904.06	-48,826,904.06
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	4,156,769,787.12	-	71,361,986.48	4,228,131,773.60
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	3,160,717,409.99	-	99,557,870.53	3,260,275,280.52
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	3,160,717,409.99	-	99,557,870.53	3,260,275,280.52

三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	170.70	-	5,928,753.85	5,928,924.55
(一)、综合收益总额	-	-	55,868,086.70	55,868,086.70
(二)、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)	170.70	-	3.20	173.90
其中: 1. 基金申购款	170.70	-	3.20	173.90
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、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)	-	-	-49,939,336.05	-49,939,336.05
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	3,160,717,580.69	-	105,486,624.38	3,266,204,205.07

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：徐卫，会计机构负责人：佻方方

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(原“博时聚利纯债债券型证券投资基金”以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]2235 号《关于准予博时聚利纯债债券型证券投资基金注册的批复》核准，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时聚利纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 210,330,974.75 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 846 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时聚利纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 210,360,154.20 份基金份额，其中认购资金利息折合 29,179.45 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金以定期开放的方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自每一个开放期结束之

日次日起（包括该日）3 个月的期间内，本基金采取封闭运作模式，基金份额持有人不得申请申购、赎回本基金。本基金的第一个封闭期为首个开放期结束之日次日起（包括该日）至 3 个月后的对应日前一日（含该日）的期间，以此类推。如不存在对应日期或该对应日为非工作日的，则顺延至下一工作日。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。自基金合同生效日起（包括该日）或每个封闭期结束之日后第一个工作日起（含该日），本基金即进入开放期，开放期的期限为 1 至 20 个工作日，具体期间由基金管理人提前公告说明，但在开放期内，基金管理人有权延长开放期时间并公告，但开放期最长不可超过 20 个工作日。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。开放期未赎回的份额将自动转入下一个封闭期。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券、资产支持证券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、同业存单、银行存款、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票、权证等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%；在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率×90%+1 年期定期存款利率（税后）×10%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注“重要会计政策和会计估计”所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 6.4.4 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

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。



当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。



#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和可分离债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和可分离债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 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，对国债、地方政府债以及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)对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，股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	3,806,149.30
等于：本金	3,805,031.06
加：应计利息	1,118.24
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,806,149.30

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目		本期末 2023年6月30日			
		成本	应计利息	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	445,491,605.76	7,339,912.33	455,380,912.33	2,549,394.24
	银行间市场	4,330,493,696.87	53,919,952.00	4,408,778,952.00	24,365,303.13
	合计	4,775,985,302.63	61,259,864.33	4,864,159,864.33	26,914,697.37
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,775,985,302.63	61,259,864.33	4,864,159,864.33	26,914,697.37

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**
**6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额**

无余额。

**6.4.7.4 买入返售金融资产**
**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无余额。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无余额。

**6.4.7.5 其他权益工具投资**
**6.4.7.5.1 其他权益工具投资情况**

无。

**6.4.7.5.2 报告期末其他权益工具投资情况**

无。

**6.4.7.6 其他资产**

无余额。

**6.4.7.7 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	-
应付交易费用	54,670.43
其中：交易所市场	-
银行间市场	54,670.43
应付利息	-
其他应付款	25,000.00
预提费用	110,958.65
合计	190,629.08

**6.4.7.8 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,160,711,559.51	3,160,711,559.51
本期申购	996,058,783.60	996,058,783.60
本期赎回（以“-”号填列）	-555.99	-555.99
本期末	4,156,769,787.12	4,156,769,787.12

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

**6.4.7.9 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	45,110,061.68	-11,608,120.33	33,501,941.35
本期利润	42,779,530.39	29,968,014.05	72,747,544.44
本期基金份额交易产生的变动数	9,483,495.53	4,455,909.22	13,939,404.75
其中：基金申购款	9,483,503.78	4,455,909.04	13,939,412.82
基金赎回款	-8.25	0.18	-8.07
本期已分配利润	-48,826,904.06	-	-48,826,904.06
本期末	48,546,183.54	22,815,802.94	71,361,986.48

**6.4.7.10 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日

活期存款利息收入	19,503.63
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	69,404.88
其他	40.09
合计	88,948.60

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

无发生额。

##### 6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无发生额。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	63,686,464.96
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-5,018,883.06
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	58,667,581.90

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	777,058,312.65
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	764,534,841.34
减：应计利息总额	17,527,429.37
减：交易费用	14,925.00
买卖债券差价收入	-5,018,883.06

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

**6.4.7.14 衍生工具收益**
**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无发生额。

**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无发生额。

**6.4.7.15 股利收益**

无发生额。

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	29,968,014.05
——股票投资	-
——债券投资	29,968,014.05
——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	29,968,014.05

**6.4.7.17 其他收入**

无发生额。

**6.4.7.18 信用减值损失**

无。

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	42,151.28
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
上交所账户维护费	9,210.00
中债登账户维护费	9,000.00

银行汇划费	20,154.36
合计	140,023.01

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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、注册登记机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,018,066.21	4,849,279.03
其中：支付销售机构的客户维护费	11.07	18.10

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 0.30% 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 × 0.30% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------



	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,672,688.76	1,616,426.34

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 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 2023年1月1日至2023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
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
招商银行股份有限公司	-	-	-	-	193,127,000.00	86,585.81

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

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
	期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	9,866,798.22	-
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	9,866,798.22	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.24%	-

注：1. 申购含红利再投、转换入、级别调整入份额，赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

2. 基金管理人博时基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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
招商银行	4,146,882,945.30	99.76%	3,160,691,153.82	100.00%

注：1. 除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

2. 持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022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-活期存款	3,806,149.30	19,503.63	3,295,499.14	26,123.90

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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
		场内	场外					
1	2023-03-13	-	2023-03-13	0.1540	48,826,888.49	15.57	48,826,904.06	-

合计			0.1540	48,826,888 .49	15.57	48,826,904 .06	-
----	--	--	--------	-------------------	-------	-------------------	---

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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 447,333,448.45 元，是以如下债券作为质押：

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
220211	22 国开 11	2023-07-03	101.60	1,200,000.00	121,921,545.21
220214	22 国开 14	2023-07-05	100.21	1,053,000.00	105,524,334.78
190203	19 国开 03	2023-07-03	102.06	782,000.00	79,807,920.55
220214	22 国开 14	2023-07-03	100.21	609,000.00	61,029,743.48
220220	22 国开 20	2023-07-03	101.08	600,000.00	60,646,356.16
220025	22 付息国债 25	2023-07-03	101.09	276,000.00	27,900,180.00
230201	23 国开 01	2023-07-03	100.97	200,000.00	20,194,027.32
合计				4,720,000.00	477,024,107.50

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告 2023 年 06 月 30 日止，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 209,922,293.60 元，于 2023 年 07 月 03 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只主动管理型债券型基金，属于中低风险品种，预期收益和风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报的投资目标。

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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	142,115,572.53	131,233,906.85
合计	142,115,572.53	131,233,906.85

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
AAA	2,746,271,059.48	2,670,183,621.90
AAA 以下	190,372,605.76	190,134,076.72
未评级	1,785,400,626.56	1,055,552,772.82
合计	4,722,044,291.80	3,915,870,471.44

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 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于开放期内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。此外，本基金还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。

于本期末，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约

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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人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》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期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。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，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%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，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。于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过 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。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。



**6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2023年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	3,806,149.30	-	-	-	3,806,149.30
结算备付金	19,343,685.18	-	-	-	19,343,685.18
存出保证金	604.88	-	-	-	604.88
交易性金融资产	1,703,113,291.57	3,029,578,423.18	131,468,149.58	-	4,864,159,864.33
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>1,726,263,730.93</b>	<b>3,029,578,423.18</b>	<b>131,468,149.58</b>	<b>-</b>	<b>4,887,310,303.69</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	657,255,742.05	-	-	-	657,255,742.05
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	116,559.59	116,559.59
应付管理人报酬	-	-	-	1,016,443.88	1,016,443.88
应付托管费	-	-	-	338,814.63	338,814.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	260,340.86	260,340.86
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	190,629.08	190,629.08
<b>负债总计</b>	<b>657,255,742.05</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,922,788.04</b>	<b>659,178,530.09</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>1,069,007,988.88</b>	<b>3,029,578,423.18</b>	<b>131,468,149.58</b>	<b>-1,922,788.04</b>	<b>4,228,131,773.60</b>
<b>上年度末 2022年12月31 日</b>					
<b>资产</b>					
银行存款	3,851,015.30	-	-	-	3,851,015.30
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	8,210.80	-	-	-	8,210.80
交易性金融资产	1,117,593,670.07	2,879,478,940.26	50,031,767.96	-	4,047,104,378.29
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-



应收申购款	-	-	-	99.92	99.92
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>1,121,452,896.17</b>	<b>2,879,478,940.26</b>	<b>50,031,767.96</b>	<b>99.92</b>	<b>4,050,963,704.31</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	855,149,033.56	-	-	-	855,149,033.56
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	811,148.83	811,148.83
应付托管费	-	-	-	270,382.94	270,382.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	206,085.19	206,085.19
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	313,552.93	313,552.93
<b>负债总计</b>	<b>855,149,033.56</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,601,169.89</b>	<b>856,750,203.45</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>266,303,862.61</b>	<b>2,879,478,940.26</b>	<b>50,031,767.96</b>	<b>-1,601,069.97</b>	<b>3,194,213,500.86</b>

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

#### 6.4.13.4.1.2 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率上升25个基点	减少约2,098	减少约1,799
市场利率下降25个基点	增加约2,117	增加约1,814	

#### 6.4.13.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，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。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 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。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	-
第二层次	4,864,159,864.33
第三层次	-
合计	4,864,159,864.33

##### 6.4.14.2.2 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证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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,864,159,864.33	99.53
	其中：债券	4,864,159,864.33	99.53
	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	23,149,834.48	0.47
8	其他各项资产	604.88	0.00
9	合计	4,887,310,303.69	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

无。

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

无。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	50,543,804.35	1.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,821,792,483.16	43.09
	其中：政策性金融债	705,537,023.18	16.69
4	企业债券	547,301,417.80	12.94
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	2,444,522,159.02	57.82
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,864,159,864.33	115.04

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	220214	22 国开 14	4,000,000	400,852,173.91	9.48
2	101900710	19 五矿 MTN001	1,300,000	132,528,464.48	3.13
3	220211	22 国开 11	1,200,000	121,921,545.21	2.88
4	102101332	21 粤交投 MTN003	1,100,000	115,479,326.03	2.73
5	102102260	21 核能电力 MTN002A	1,000,000	102,777,528.77	2.43

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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江西监管局、宁夏监管局和广东监管局的处罚。宁波银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局的处罚。平安银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会辽宁监管局、上海监管局的处罚。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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	604.88
2	应收清算款	-
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	604.88

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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
503	8,263,955.84	4,156,749,843.38	100.00%	19,943.74	0.00%

### 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	1,116.65	0.00%

### 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

- 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	9,866,798.22	0.24%	9,866,798.22	0.24%	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	9,866,798.22	0.24%	9,866,798.22	0.24%	-

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 9 月 18 日）基金份额总额	210,360,154.20
本报告期期初基金份额总额	3,160,711,559.51
本报告期基金总申购份额	996,058,783.60
减：本报告期基金总赎回份额	555.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	4,156,769,787.12

### § 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

基金管理人于 2023 年 2 月 18 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》，邵凯先生离任公司副总经理，继续担任公司投资决策委员会委员。

基金管理人于 2023 年 5 月 27 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》，孙献离任公司财务负责人；吴慧峰任公司副总经理、财务负责人。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。



### 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

2022 年 12 月 20 日，博时聚利纯债债券型证券投资基金通过持有人大会方式表决通过了《博时聚利纯债债券型证券投资基金转型有关事项的议案》。自 2023 年 1 月 19 日起，“博时聚利纯债债券型证券投资基金”转型为“博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金”，《博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》及《博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》自该日起生效，基金投资策略相应变更。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

#### 10.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48 号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

(1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；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
国泰君安	130,000,000.00	54.15%	9,498,700,000.00	58.92%	-	-
中信建投	110,090,742.74	45.85%	6,623,000,000.00	41.08%	-	-

### 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关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230601	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01
2	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-27
3	博时聚利纯债 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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-17
4	博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-22
5	博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2022 年年度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-30
6	博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-09
7	博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-23

8	博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-22
9	博时基金管理有限公司关于博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理变更的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-22
10	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-18
11	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通兴业银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-13
12	博时聚利纯债债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-20
13	博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-19
14	博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-16
15	博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-16
16	博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-16
17	博时聚利纯债 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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-16
18	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-20230104	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-04

## § 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%	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		的时间区间					
机构	1	2023-01-01~ 2023-06-30	3,160,691,15 3.82	-	-	3,160,691, 153.82	76.04%
	2	2023-06-06~ 2023-06-30	-	986,191, 791.48	-	986,191,79 1.48	23.72%

#### 产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

注：1. 申购份额包含红利再投资份额。

2. 份额占比为四舍五入后的结果。

## 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

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件
- 2、《博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《博时聚利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时聚利纯债 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
- 6、报告期内博时聚利纯债 3 个月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

## 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  
二〇二三年八月三十一日