

**博时富耀纯债一年定期开放债券型发起式
证券投资基金
2024年第2季度报告
2024年6月30日**

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年七月十九日

§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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 17 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 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 博时富耀一年定开债发起式 |
| 基金主代码 | 018407 |
| 交易代码 | 018407 |
| 基金运作方式 | 契约型 定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 6 月 7 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,009,999,900.00 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，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。充分发挥基金管理人长期积累的信用研究成果，利用自主开发的信用分析系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，以获取最大化的信用溢价。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、个券挖掘策略等。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。</p> <p>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</p> |

| | |
|--------|--|
| | 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。 灵活应用各种期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、个券挖掘策略、可转换债券及可交换债券投资策略、信用衍生品投资策略、国债期货投资策略等，在合理管理并控制组合风险的前提下，最大化组合收益。 （二）开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富（总值）指数收益率×90%+1 年期定期存款利率（税后）×10% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。 |
| 基金管理人 | 博时基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 |

§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 (2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) |
|----------------|---|
| 1.本期已实现收益 | 17,902,464.43 |
| 2.本期利润 | 27,502,675.24 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0137 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,065,318,331.18 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0275 |

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。

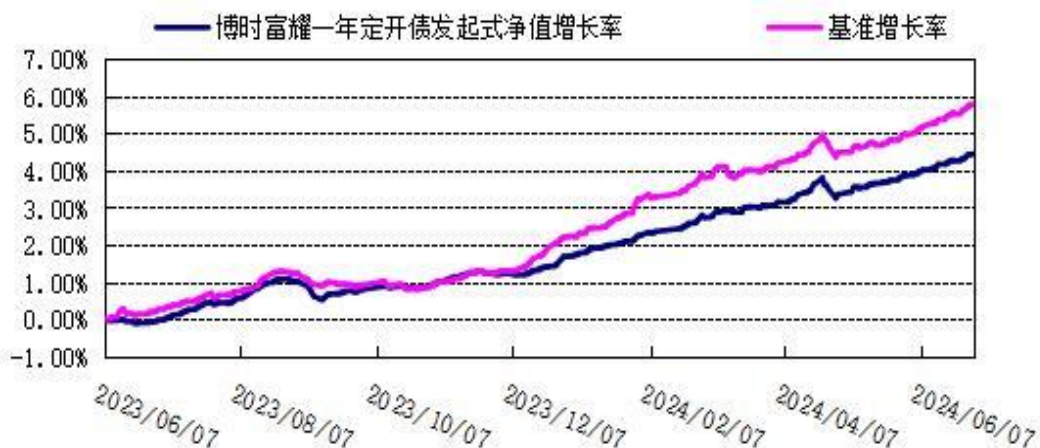
3.2 基金净值表现

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 |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 1.34% | 0.05% | 1.60% | 0.06% | -0.26% | -0.01% |
| 过去六个月 | 2.71% | 0.04% | 3.46% | 0.06% | -0.75% | -0.02% |
| 过去一年 | 4.46% | 0.04% | 5.48% | 0.05% | -1.02% | -0.01% |

| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 4.47% | 0.04% | 5.79% | 0.05% | -1.32% | -0.01% |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|

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 6 月 7 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。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(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 | 2023-06-21 | - | 9.9 | 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。 |
| 李汉楠 | 基金经理 | 2023-06-07 | 2024-06-25 | 9.9 | 李汉楠先生, 硕士。2014 年至 2019 年在长城基金工作。2019 年加入博时基金管理有限公司。历任博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金(2020 年 5 月 27 日-2021 年 8 月 17 日)、博时信用优选债券型证券投资基金(2020 年 5 月 22 日-2022 年 5 月 5 日)、博时安瑞 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2019 年 12 月 23 日-2022 年 7 月 1 日)、博时富汇纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2021 年 8 月 17 日-2022 年 9 月 9 日)、博时富盛纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2021 年 8 月 17 日-2022 年 9 月 9 日)、博时荣升稳健添利 18 个月定期开放混合型证券投资基金(2020 年 4 月 29 日-2023 年 3 月 23 日)、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2月17日-2023年7月28日)、博时裕瑞纯债债券型证券投资基金(2022年2月17日-2024年4月3日)、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7日-2024年6月25日)的基金经理。现任博时富灿纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2021年4月13日—至今)、博时丰庆纯债债券型证券投资基金(2022年2月17日—至今)、博时裕昂纯债债券型证券投资基金(2022年2月17日—至今)、博时裕创纯债债券型证券投资基金(2022年2月17日—至今)、博时裕泰纯债债券型证券投资基金(2022年2月17日—至今)、博时富元纯债债券型证券投资基金(2023年4月20日—至今)、博时安仁一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2023年7月26日—至今)、博时裕盛纯债债券型证券投资基金(2023年7月26日—至今)、博时裕安纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2023年7月26日—至今)、博时富华纯债债券型证券投资基金(2023年7月26日—至今)的基金经理,博时富信纯债债券型证券投资基金、博时富泽金融债券型证券投资基金、博时富顺纯债债券型证券投资基金、博时安盈债券型证券投资基金、博时富祥纯债债券型证券投资基金的基金经理助理。 |
| 魏桢 | 董事总经理/固定收 | 2023-06-21 | - | 15.9 | 魏桢女士, 硕士。2004年起在厦门市商业银行任债券交 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | 益投资二 部总经理/ 固定收益 投资二部 投资总监/ 基金经理 | | | <p>易组主管。2008 年加入博时基金管理有限公司。历任债券交易员、固定收益研究员、博时理财 30 天债券型证券投资基金(2013 年 1 月 28 日-2015 年 9 月 11 日)、博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金(2013 年 6 月 26 日-2016 年 4 月 25 日)、博时月月薪定期支付债券型证券投资基金(2013 年 7 月 25 日-2016 年 4 月 25 日)、博时双月薪定期支付债券型证券投资基金(2013 年 10 月 22 日-2016 年 4 月 25 日)、博时天天增利货币市场基金(2014 年 8 月 25 日-2017 年 4 月 26 日)、博时保证金实时交易型货币市场基金(2015 年 6 月 8 日-2017 年 4 月 26 日)、博时安盈债券型证券投资基金(2015 年 5 月 22 日-2017 年 5 月 31 日)、博时产业债纯债债券型证券投资基金(2016 年 5 月 25 日-2017 年 5 月 31 日)、博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2015 年 11 月 24 日-2017 年 6 月 15 日)、博时聚享纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 19 日-2017 年 10 月 27 日)、博时安仁一年定期开放债券型证券投资基金(2016 年 6 月 24 日-2017 年 11 月 8 日)、博时裕鹏纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 22 日-2017 年 12 月 29 日)、博时安润 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2016 年 5 月 20 日-2018 年 1 月 12 日)、博时安恒 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2016 年 9 月 22 日-2018 年 4 月 2 日)、博</p> |
|--|--|--|--|--|

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | 时安丰 18 个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)(2013 年 8 月 22 日-2018 年 6 月 21 日)的基金经理、固定收益总部现金管理组投资副总监、博时现金宝货币市场基金(2014 年 9 月 18 日-2019 年 2 月 25 日)、博时外服货币市场基金(2015 年 6 月 19 日-2019 年 2 月 25 日)、博时合利货币市场基金(2016 年 8 月 3 日-2019 年 2 月 25 日)、博时合鑫货币市场基金(2016 年 10 月 12 日-2019 年 2 月 25 日)、博时合晶货币市场基金(2017 年 8 月 2 日-2019 年 2 月 25 日)、博时兴盛货币市场基金(2017 年 12 月 29 日-2019 年 2 月 25 日)、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金(2014 年 9 月 22 日-2019 年 3 月 4 日)、博时裕创纯债债券型证券投资基金(2016 年 5 月 13 日-2019 年 3 月 4 日)、博时裕盛纯债债券型证券投资基金(2016 年 5 月 20 日-2019 年 3 月 4 日)、博时丰庆纯债债券型证券投资基金(2017 年 8 月 23 日-2019 年 3 月 4 日)、博时安弘一年定期开放债券型证券投资基金(2016 年 11 月 15 日-2019 年 11 月 12 日)的基金经理、固定收益总部现金管理组负责人、博时裕安纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2020 年 5 月 8 日-2021 年 10 月 27 日)、博时安仁一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2020 年 9 月 9 日-2021 年 10 月 27 日)、博时月月享 30 天持有期短债债券型发起式证 |
|--|--|--|--|--|

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | 券投资基金(2021 年 5 月 12 日-2024 年 6 月 7 日)、博时月月乐同业存单 30 天持有期混合型证券投资基金(2022 年 6 月 7 日-2024 年 6 月 7 日)的基金经理。现任董事总经理兼固定收益投资二部总经理、固定收益投资二部投资总监、博时现金收益证券投资基金(2015 年 5 月 22 日—至今)、博时合惠货币市场基金(2017 年 5 月 31 日—至今)、博时安弘一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2019 年 11 月 12 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)、博时锦源利率债债券型证券投资基金(2023 年 12 月 13 日—至今)、博时中债 5-10 年农发行债券指数证券投资基金(2024 年 3 月 12 日—至今)、博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 3 月 12 日—至今)、博时保证金实时交易型货币市场基金(2024 年 3 月 12 日—至今)、博时中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金(2024 年 3 月 12 日—至今)的基金经理。 |
|--|--|--|--|---|

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，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 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 22 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

2024 年二季度，债券市场收益率震荡下行。具体来看，4 月初，供给压力减轻，同时资金宽松，1 年大行存单收益率下行幅度超过 20bp，10 年、30 年国债收益率最低分别下行至 2.23%、2.42% 附近。4 月 23 日，媒体刊登央行关于长期国债收益率和二级买卖国债相关采访，对央行调控收益率曲线的担忧，债市出现明显调整，10 年、30 年国债收益率分别升至 2.35%、2.58%，曲线陡峭化上行。5 月份，市场多空交织、利率窄幅震荡。一方面，资金面维持宽松，R007 和 DR007 加权利率一度收敛到 1.8% 附近；PMI 等数据显示需求有逐步走弱迹象。另一方面，央行反复提及长端利率对现券市场情绪形成压制，各地地产政策继续放松影响政策预期。在这一阶段，受到手工补息政策叫停的推动，资产荒逻辑进一步演绎，信用债表现明显好于利率债，例如 2 年隐含评级 AA+ 城投债收益率全月累计下行 15bp 至 2.25% 左右。6 月份，经济金融数据放缓，风险偏好下降，市场向久期要收益，长端利率走出一波明显下行行情，10 年国债收益率降至二季度最低点 2.21%。高流动性的利率、商金品种在 6 月份表现略好于非金融信用债，信用利差小幅被动走扩。

展望后市，预计三季度债市趋势仍在但波动加大。宏观经济方面，地产销售增速底部走平，广义财政的力度仍未见起色。货币政策方面，灵活适度、精准有效的主基调不会变，流动性仍将维持合理充裕。宏观经济和流动性宽松大环境下，债券市场趋势仍在。债券资产收益已处于历史低位，后续的波动会加大，对于汇率、国内流动性与地产政策效果保持紧密关注。

组合操作上，以短端信用债与中长期利率债的哑铃型结构应对市场变化，久期弹性通过利率仓位的摆布来实现，杠杆方面结合实际的流动性状况来调整。收益率低位环境下波动会加大，适度博弈预期差下的交易机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.0275 元，份额累计净值为 1.0446 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 1.34%，同期业绩基准增长率为 1.60%。

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 | 2,887,178,398.94 | 99.00 |
| | 其中：债券 | 2,887,178,398.94 | 99.00 |
| | 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 | 29,057,148.98 | 1.00 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,791.25 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 2,916,238,339.17 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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 | 26,747,377.05 | 1.30 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 709,177,607.12 | 34.34 |
| | 其中：政策性金融债 | 586,076,940.82 | 28.38 |
| 4 | 企业债券 | 443,440,341.72 | 21.47 |
| 5 | 企业短期融资券 | 133,403,443.71 | 6.46 |
| 6 | 中期票据 | 1,574,409,629.34 | 76.23 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,887,178,398.94 | 139.79 |

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 | 09230220 | 23 国开清发 20 | 1,000,000 | 111,909,590.16 | 5.42 |
| 2 | 220307 | 22 进出 07 | 1,000,000 | 105,315,901.64 | 5.10 |
| 3 | 230410 | 23 农发 10 | 1,000,000 | 104,176,301.37 | 5.04 |
| 4 | 240410 | 24 农发 10 | 1,000,000 | 101,789,041.10 | 4.93 |
| 5 | 190406 | 19 农发 06 | 500,000 | 55,713,797.81 | 2.70 |

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，中国农业发展银行在报告编制前一年受到国家外汇管理局淄博市分局、国家金融监督管理总局陕西监管局的处罚。国家开发银行在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局湖北监管局的处罚。中国进出口银行在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局吉林监管局、国家外汇管理局黑龙江省分局的处罚。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 | 2,791.25 |
| 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 | 2,791.25 |

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

| | |
|----------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,009,999,900.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,009,999,900.00 |

§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

| | |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,000,900.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 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 |

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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|--------------|---------------|--------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|-------------------------|------------------|------|------|------------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2024-04-01~2024-06-30 | 1,999,999,000.00 | - | - | 1,999,999,000.00 | 99.50% |

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。

在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，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。

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。

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 2024 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 385 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 16037 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 5965 亿元人民币，累计分红逾 2009 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

§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耀纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件
- 2、《博时富耀纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《博时富耀纯债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、博时富耀纯债一年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、报告期内博时富耀纯债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

二〇二四年七月十九日