博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金

2026年第3季度报告

2026年09月30日

基金管理人:博远基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2026年10月27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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年7月1日起至2026年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博远利兴纯债一年定开债券发起式
基金主代码	016015
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2022年08月08日
报告期末基金份额总额	1,463,914,344.23份
投资目标	本基金在有效控制投资组合风险并保持良好流动性的前提下，力争获得稳定增长的投资收益。
投资策略	本基金采用定期开放运作方式，封闭期和开放期的投资重点有所区别。封闭期的投资偏重于有效控制风险，追求基金资产的稳健增值；开放期则以流动性管理为主，有效应对投资者的申赎需求。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+一年期银行定期存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本基金是债券型基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于股票型和混合型基金。
基金管理人	博远基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§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（2026年07月01日 - 2026年09月30日）
1.本期已实现收益	8,904,906.97
2.本期利润	8,177,329.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.0056
4.期末基金资产净值	1,499,577,618.04
5.期末基金份额净值	1.0244

注：1、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。

2、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 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.54%	0.02%	0.51%	0.03%	0.03%	-0.01%
过去六个月	1.25%	0.02%	1.11%	0.03%	0.14%	-0.01%
过去一年	2.80%	0.02%	1.48%	0.04%	1.32%	-0.02%
过去三年	9.15%	0.04%	5.55%	0.07%	3.60%	-0.03%
自基金合同生效起至今	12.07%	0.05%	6.34%	0.06%	5.73%	-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



§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		
黄婧丽	固定收益投资总部总经理、本基金基金经理	2022-08-08	-	13年	黄婧丽女士，中国国籍，具有基金从业资格，毕业于伦敦帝国理工学院，硕士研究生。历任世纪证券有限责任公司固定收益研究员、国海证券股份有限公司固定收益投资经理助理、东吴基金管理有限公司投资经理、基金经理。2021年8月加入博远基金管理有限公司，任固定收益投资总部基金经理，自2024年7月24日起任固定收益投资总部部门总经理、基金经理。2018年1月至2021年1月任东吴优益债券型证券投资基金基金经理；20

					18年5月至2020年12月任东吴悦秀纯债债券型证券投资基金基金经理；2018年11月至2021年7月任东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金经理；2019年3月至2021年1月任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理；2021年12月13日起任博远臻享3个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；2022年3月8日至2024年7月8日兼任博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金基金经理；2022年6月2日起兼任博远增益纯债债券型证券投资基金基金经理；2022年8月8日起兼任博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2022年12月14日起兼任博远增睿纯债债券型证券投资基金基金经理；2023年11月24日起兼任博远增裕利率债债券型证券投资基金基金经理；2024年8月7日起兼任博远增汇纯债债券型证券投资基金基金经理。
钟鸣远	公司总经理兼财务负责人、首席信息官，本基金基金经理	2026-03-05	-	29年	钟鸣远先生，中国国籍，毕业于复旦大学金融学专业，经济学硕士学位，具有基金从业资格。现任博远基金管理有限公司总经理兼财务负责人、首席信息官。历任国家开发银行深圳分行资金计划部职员，联合证券有限责任公司固定收益部投

					资经理，泰康人寿保险股份有限公司固定收益策略研究员，新华资产管理股份有限公司固定收益部高级投资经理，易方达基金管理有限公司固定收益总部总经理兼固定收益投资部总经理，大成基金管理有限公司副总经理。2019年11月19日起任博远增强回报债券型证券投资基金基金经理；2020年4月15日至2024年12月27日兼任博远双债增利混合型证券投资基金基金经理；2020年7月8日至2023年7月28日兼任博远博锐混合型发起式证券投资基金基金经理；2020年9月30日至2023年3月23日兼任博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金基金经理；2021年3月30日至2023年5月16日兼任博远优享混合型证券投资基金基金经理；2021年12月13日起兼任博远臻享3个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；2022年4月28日至2023年5月16日兼任博远增益纯债债券型证券投资基金基金经理；2023年11月24日起兼任博远增裕利率债债券型证券投资基金基金经理；2024年8月12日起兼任博远增汇纯债债券型证券投资基金基金经理；2025年10月17日起兼任博远增睿纯债债券型

					证券投资基金基金经理；2026年3月5日起兼任博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日。
2、证券从业年限的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益。本报告期内，本基金运作无重大违法、违规行为，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司制度的规定，通过系统和人工等各种方式在各业务环节监控交易的公平执行，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对于因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，由相关投资组合经理出具决策依据，并留存记录备查；对于不同投资组合在不同时间窗口下相邻交易日（1日内、3日内、5日内）的同向交易及反向交易，未发现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本报告期内，本基金继续以金融债为主要投资标的，继续增加证券公司债的配置，加配了部分商业银行二级资本债，并降低了短期限利率债的投资比例，组合整体杠杆率稳步提升了约5%。

2026年三季度，债券市场在基本面“弱现实”与货币政策宽松预期的双轮驱动下震荡走强，收益率曲线趋于平坦化，呈短端上行、长端下行的分化格局。其中，1年国债收益率由6月末的1.12%上行至1.22%，约上行10BP；10年国债由1.73%下行至1.68%，约

下行5BP；30年国债由2.24%下行至2.10%，约下行14BP。曲线形态由二季度的“牛陡”切换为“牛平”，10年国债与1年国债利差由7月初约61BP压缩至约46BP，30年国债与10年国债利差由约50BP收窄至约42BP。

三季度债市震荡走强是多重因素合力的结果。首先，基本面“弱现实”构成核心利多因素。7月制造业PMI回落至49.2%并跌破荣枯线，8月仅回升至49.8%，仍在收缩区间；8月社零同比增长0.4%；而主要受地产板块持续影响，1-8月固定资产投资同比下降7.2%，内需修复仍面临一定压力。再者，货币政策的宽松预期进一步推动了收益率下行。7月政治局会议提出“综合运用并适时调整货币政策工具”，点燃了市场对降准降息的预期。尽管“双降”并未在三季度落地，但在“精准滴灌”的央行政策下，流动性维持合理充裕。具体而言，央行7月对MLF净投放1000亿、买断式逆回购净投放7000亿并恢复公开市场购买国债500亿，8月启用隔夜逆回购工具，9月重启14天逆回购并超额续作MLF。除此以外，央行在9月29日实施了结构性降息措施：下调PSL利率25BP、将“六张网”建设纳入PSL贷款项目范围、分别调增科创技改再贷款和支农支小再贷款额度2000亿及5000亿，并联合财政部、金融监管总局对符合条件的购房者实施贷款贴息。最后，三季度本是政府债券供给高峰，债券市场却出现“反季节性”的走势，很大程度得益于理财、保险、银行等配置盘的承接力度较强，以及摊余成本法债基的扩容使得市场对于增量资金有所期望。

展望四季度，考虑到完成全年经济目标压力相对可控，且当前外部环境总体平稳，年底前出台大规模刺激政策的概率有限；而特别国债为大行补充核心资本、摊余成本法基金陆续获批并进入建仓期，均有望为市场带来中长期资金的补充，债市仍具备配置空间。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末博远利兴纯债一年定开债券发起式基金份额净值为1.0244元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.54%，同期业绩比较基准收益率为0.51%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	2,371,603,135.94	99.97
	其中：债券	2,371,603,135.94	99.97
	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	763,341.84	0.03
8	其他资产	-	-
9	合计	2,372,366,477.78	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	954,877,341.38	63.68
	其中：政策性金融债	151,163,139.73	10.08
4	企业债券	1,365,862,186.34	91.08
5	企业短期融资券	50,863,608.22	3.39
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	2,371,603,135.94	158.15

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	2522029	25国银金租债03	1,400,000	140,999,791.78	9.40
2	210210	21国开10	1,000,000	109,633,726.03	7.31
3	242691	25平证11	1,000,000	102,599,600.00	6.84
4	524644	26华股02	1,000,000	101,110,465.75	6.74
5	244566	26招证S2	1,000,000	101,025,726.03	6.74

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除26华股02（524644.SZ）、26申证C1（524918.SZ）、26西部02（524775.SZ）、25国券G2（243347.SH）的发行主体外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券之一的26华股02（524644.SZ）发行主体华西证券股份有限公司因债券项目工作尽职调查不到位等事项，于2026年3月19日被中国证券监督管理委员会四川监管局采取责令改正措施（〔2026〕22号）。

本基金投资的前十名证券之一的26申证C1（524918.SZ）发行主体申万宏源证券有限公司因个别私募资管产品发生可能影响投资者利益的重大事项时，未在事项发生之日

起五日内向投资者披露等事项，于2025年10月22日收到中国证券监督管理委员会上海监管局警示函（沪证监决〔2025〕201号）。

本基金投资的前十名证券之一的26西部02（524775.SZ）发行主体西部证券股份有限公司因在首次公开发行股票项目中对发行人未予以充分关注并审慎核查等事项，于2026年8月21日受到深圳证券交易所上市审核中心监管谈话（审核中心监管函〔2026〕7号）；因违反反洗钱法等事项，于2026年3月30日受到中国人民银行陕西省分行处罚（陕银罚决字〔2026〕3号）。

本基金投资的前十名证券之一的25国券G2（243347.SH）发行主体国投证券股份有限公司因未按照规定开展客户尽职调查等事项，于2026年6月22日受到中国人民银行处罚（银罚决字〔2026〕71号）。

本基金管理人认为，以上监管措施及处罚不会对其投资价值构成实质性影响。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

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

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,463,914,344.23
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（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,463,914,344.23

注：总申购份额含红利再投（如有）、转换入份额（如有），总赎回份额含转换出份额（如有）。

§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	500,000.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	500,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.03

注：总申购份额含红利再投（如有）、转换入份额（如有）、因份额拆分而增加的份额（如有）；总赎回份额含转换出份额（如有）、因份额合并而减少的份额（如有）。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的交易明细。

§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	500,000.00	0.03%	10,000,850.00	0.68%	3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	500,000.00	0.03%	10,000,850.00	0.68%	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

类别		20%的时间区间					
机构	1	20260701-20260930	1,463,414,146.34	-	-	1,463,414,146.34	99.97%
产品特有风险							
（1）不能及时应对赎回的风险 持有份额比例较高的基金份额持有人（以下简称"高比例投资者"）大额赎回时，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。 （2）基金净值大幅波动的风险 当高比例投资者大量赎回时，基金管理人为支付赎回款项而变现基金资产，可能造成资产价格波动，导致本基金资产净值发生波动。若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。若高比例投资者大量赎回本基金，计算基金份额净值时进行四舍五入也可能引起基金份额净值发生波动。 （3）基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。 （4）基金面临转型、合并或提前终止的风险 高比例投资者赎回后，可能会导致出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金注册的文件；

2、《博远利兴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、《博远利兴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、《博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新；

5、博远基金管理有限公司业务资格批准文件、营业执照；

6、本报告期内本基金在符合中国证监会规定条件的全国性报刊上披露的各项公告原件。

10.2 存放地点

深圳市福田区皇岗路5001号深业上城T2栋4301室博远基金管理有限公司

10.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人住所免费查询，或登录中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund/）及基金管理人网站（http://www.boyuanfunds.com）查阅。

博远基金管理有限公司

2026年10月27日