

# 博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资 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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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

<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.....	5
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>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
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.....	12
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 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
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.....	33
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.....	33
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.....	34
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.....	34
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	34
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	34

7.12 投资组合报告附注.....	34
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>35</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	35
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	35
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.....	35
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>36</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>36</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
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.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4 基金投资策略的改变.....	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	36
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.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 其他重大事件.....	38
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>40</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.....	40
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	41
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>41</b>
12.1 备查文件目录.....	41
12.2 存放地点.....	41
12.3 查阅方式.....	41

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金	
基金简称	博时中债 1-3 年国开行	
基金主代码	007147	
交易代码	007147	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 4 月 22 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	
报告期末基金份额总额	5,079,718,838.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时中债 1-3 年国开行 A	博时中债 1-3 年国开行 C
下属分级基金的交易代码	007147	007148
报告期末下属分级基金的份额总额	5,079,413,431.15 份	305,407.13 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.25%，年化跟踪误差控制在 3% 以内。
投资策略	<p>本基金为指数型基金，采用抽样复制和动态最优化的方法为主，选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的债券，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。</p> <p>（一）资产配置策略。本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。本基金跟踪标的指数成份券和备选成份券的资产比例不低于本基金非现金基金资产的 80%。</p> <p>（二）债券投资策略。基于基金流动性管理和有效利用基金资产的需要，本基金将投资于流动性较好的指数成份券等债券，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。本基金将根据宏观经济形势、货币政策、证券市场变化等分析判断未来利率变化，结合债券定价技术，进行个券选择。</p> <p>1、抽样复制策略。本基金通过抽样复制和动态最优化的方法进行被动式指数化投资，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采用适当方法，如“久期盯住”等优化策略对基金资产进行调整，降低交易成本，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>2、替代性策略。当成份券市场流动性不足或因法规规定本基金不能投资关联方债券等情况导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资备选成份券为主，并辅以非成份券等金融工具来构建替代组合</p>

	进行跟踪复制。 在正常市场情况下，基金管理人力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 3%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中债-1-3 年国开行债券指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为债券型指数基金，属于中低风险收益水平，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 本基金为指数型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。

### 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	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	石立平
	联系电话	0755-83169999	010-63639180
	电子邮箱	service@bosera.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		95105568	95595
传真		0755-83195140	010-63639132
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	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		518040	100033
法定代表人		江向阳	李晓鹏

### 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)	
	博时中债 1-3 年国开行 A	博时中债 1-3 年国开行 C
本期已实现收益	108,800,061.32	24,765.05
本期利润	95,889,537.53	2,992.77
加权平均基金份额本期利润	0.0145	0.0018
本期加权平均净值利润率	1.43%	0.18%
本期基金份额净值增长率	1.65%	1.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	博时中债 1-3 年国开行 A	博时中债 1-3 年国开行 C
期末可供分配利润	71,516,252.06	3,982.67
期末可供分配基金份额利润	0.0141	0.0130
期末基金资产净值	5,165,799,118.03	310,281.70
期末基金份额净值	1.0170	1.0160
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	博时中债 1-3 年国开行 A	博时中债 1-3 年国开行 C
基金份额累计净值增长率	6.47%	6.14%

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

#### 博时中债 1-3 年国开行 A

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%	0.02%	0.28%	0.02%	0.03%	0.00%
过去三个月	1.10%	0.02%	1.06%	0.02%	0.04%	0.00%
过去六个月	1.65%	0.04%	1.58%	0.03%	0.07%	0.01%
过去一年	2.31%	0.05%	2.74%	0.04%	-0.43%	0.01%
自基金合同生效起至今	6.47%	0.06%	7.29%	0.05%	-0.82%	0.01%

#### 博时中债 1-3 年国开行 C

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	0.30%	0.02%	0.28%	0.02%	0.02%	0.00%



过去三个月	1.00%	0.02%	1.06%	0.02%	-0.06%	0.00%
过去六个月	1.52%	0.04%	1.58%	0.03%	-0.06%	0.01%
过去一年	2.13%	0.05%	2.74%	0.04%	-0.61%	0.01%
自基金合同生效起至今	6.14%	0.06%	7.29%	0.05%	-1.15%	0.01%

注：本基金业绩比较基准为：中债-1-3 年国开行债券指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

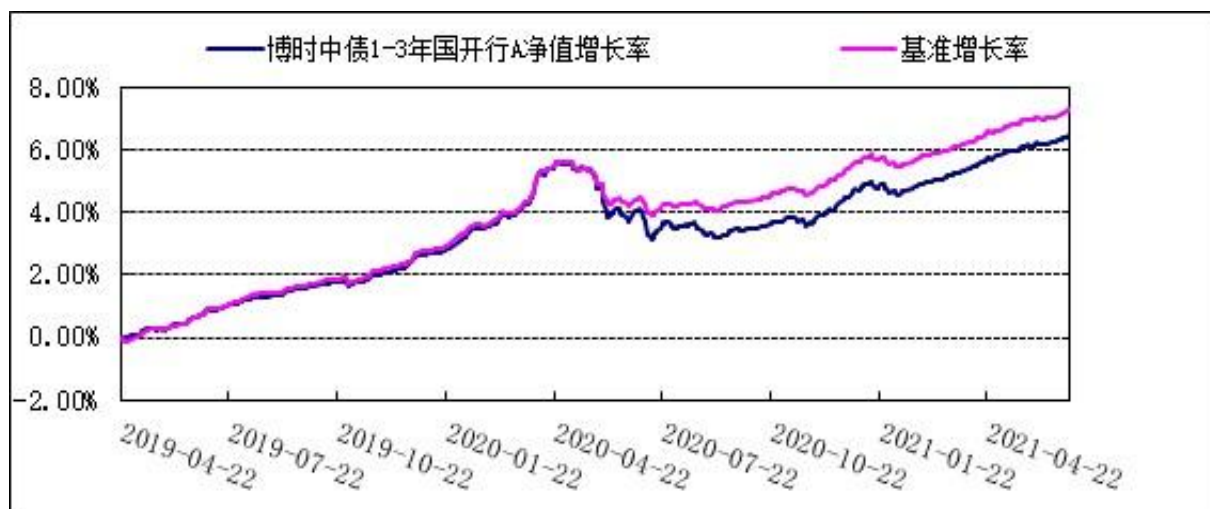
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金

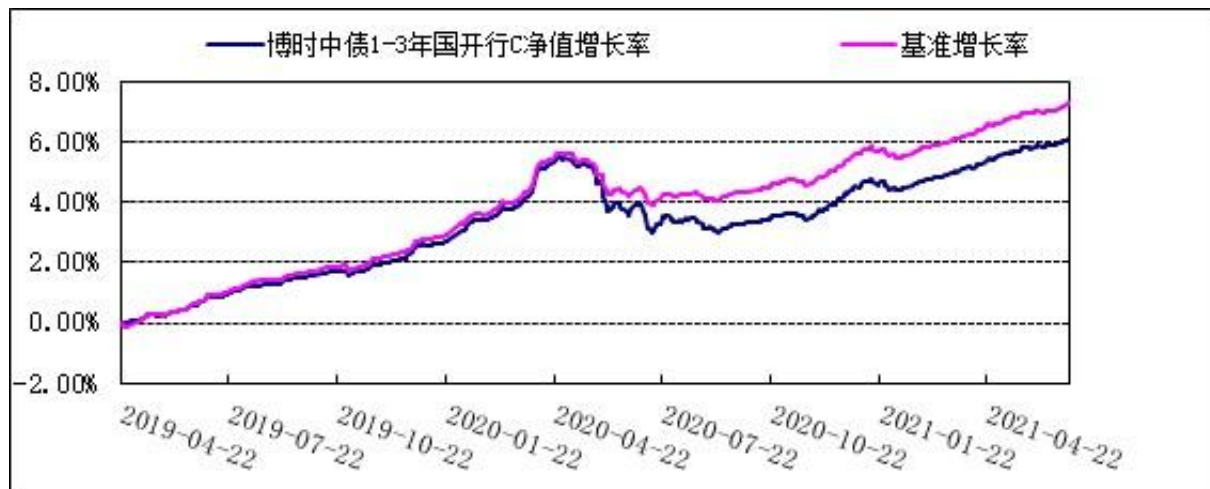
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019 年 4 月 22 日至 2021 年 6 月 30 日)

#### 博时中债 1-3 年国开行 A



#### 博时中债 1-3 年国开行 C





## § 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		
万志文	基金经理	2020-10-26	-	5.9	万志文先生，硕士。2015 年从清华大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员兼基金经理助理。现任博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金(2020 年 10 月 26 日一至今)、博时中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金(2020 年 10 月 26 日一至今)的基金经理。
卞竑	基金经理助理	2020-04-16	-	10.3	2011 年 4 月起在国开证券有限责任公司工作。2017 年 6 月 19 日加入博时基金管理有限公司，曾任固定收益总部研究员，现任固定收益总部基金经理助理。

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

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细

则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

### 4.3 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 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。

### 4.4 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

2021 年上半年债市收益率整体先上后下的格局。1 月上旬小幅下行，此后整体呈上行格局，不过 3 月上旬开始收益率再次平稳下行。具体看，1 月上旬，国债国开收益率小幅震荡下行，市场延续了节前货币政策“不急转弯”的预期及判断，叠加开年以来整体债券供给压力不大，市场配置力量强劲，收益率震荡下行，1 月下旬到 2 月初，一方面是缴准、缴税及节前取现导致的资金缺口，另一方面央行的投放力度边际减弱，市场预期永煤事件后央行的流动性宽松动作可能已经告一段落，且关注到央行货币政策的态度有边际变化，债市利率跟随资金利率上行，其中短端债市利率在 2 月小幅回调，长端债市利率自 1 月下旬以来呈上行趋势。3 月份，央行虽然净投放仍然为负，但债市利率在财政投放支撑下的流动性宽松、政策面两会召开、国际摩擦增加等因素共同作用下趋于下行。4 月上旬市场一度担忧 2 季度地方债供给压力，以及全球大宗商品大幅上涨造成的通胀压力可能迫使货币政策收敛，债市收益率一度震荡上行。但随后地方债实际发行量低于预期，市场流动性持续保持宽松，央行多次通过不同渠道释放货币政策稳定信号。在机构“资产荒”逻辑下，4 月下旬至 5 月中旬债市收益率出现快速下行。10 年国债收益率一度接近 3% 的关键点位。但 6 月随着半年末时点临近，市场担忧半年末资金波动，同时地方债发行在某些时点增多，机构“欠配”情况有所缓解，债市收益率出现反弹，随着 6 月下旬央行 300 亿续作 OMO，给了市场呵护半年末资金面的信心，同

时半年末资金面确实波动不大，资金利率再度快速下行。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0170 元，份额累计净值为 1.0633 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0160 元，份额累计净值为 1.0601 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 1.65%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 1.52%，同期业绩基准增长率为 1.58%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，经济基本面延续从疫情之后逐步复苏的态势，但复苏动能边际继续放缓，同时复苏呈现显著的分化格局，表现在上游企业和中下游的分化、出口部门及非出口部门的分化、高收入阶层与中低收入阶层的分化等，经济复苏存在不充分、不均衡的特点。通胀方面，本轮 PPI 同比高点可能已经出现，但后续仍将维持高位不会快速回落，PPI 向 CPI 的传导仍在进行中，但 CPI 预计仍会维持较为温和的态势，尤其是核心 CPI，今年可能都不会超过 2%，PPI 上涨幅度较大更多是由外部供需错位所影响，海外流动性的宽松带动需求上升，而供给受疫情及长期资本开支不佳影响恢复较弱，货币政策对这种通胀格局及原因作用不大，这也意味着这种格局的通胀不会影响货币政策的决断。海外方面，美欧经济继续修复，美联储很可能在三季度释放货币政策收敛信号。在这样的格局下，国内货币政策将继续“以我为主”，央行为了应对结构性经济压力，同时对冲 7 月份到期的 MLF，操作了全面降准，预计下半年整体流动性稳中趋松。但由于今年财政后置现象明显，下半年地方债发行进度可能加快，社融继续收敛的速度可能边际也将有所放缓。在这样的宏观环境下，预计下半年债市仍将延续区间震荡，小幅下行的格局。在货币政策保持稳定甚至偏宽的背景下，中短端债券表现可能占优。

投资策略上，本基金作为被动指数债券型基金，仍会以最小化跟踪误差为目标，紧密跟踪标的债券指数。同时会进行债券资产的切换，力争在不对久期敞口过度放大的情况下做到组合收益的增厚。

#### 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 2021 年 2 月 4 日发布公告，以 2021 年 1 月 29 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.0070 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.0070 元人民币；

本基金管理人于 2021 年 4 月 30 日发布公告，以 2021 年 4 月 27 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.0700 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.0610 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管

人所应尽的义务。

## 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

## 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——博时基金管理有限公司编制的《博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金 2021 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确。

# § 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：博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	1,852,089.22	495,625,148.56
结算备付金		-	38,353.45
存出保证金		586.65	269.78
交易性金融资产	6.4.3.2	5,519,957,000.00	10,911,296,680.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,519,957,000.00	10,911,296,680.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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	93,275,971.52	181,939,158.29
应收股利		-	-
应收申购款		799.99	510.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		5,615,086,447.38	11,588,900,120.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		396,168,101.90	-
应付证券清算款		50,754,800.00	4,082,266.30
应付赎回款		1,060.69	981.76
应付管理人报酬		635,630.90	304,340.20
应付托管费		211,876.98	101,446.74
应付销售服务费		17.64	169.60
应付交易费用	6.4.3.7	77,685.95	56,336.87
应交税费		-	-
应付利息		58,158.34	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	1,069,715.25	255,152.60
负债合计		448,977,047.65	4,800,694.07
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	5,079,718,838.28	11,490,496,236.80
未分配利润	6.4.3.10	86,390,561.45	93,603,189.21
所有者权益合计		5,166,109,399.73	11,584,099,426.01
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>5,615,086,447.38</b>	<b>11,588,900,120.08</b>

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 5,079,718,838.28 份。其中 A 类基金份额净值 1.0170 元，基金份额总额 5,079,413,431.15 份；C 类基金份额净值 1.0160 元，基金份额总额 305,407.13 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金

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		109,107,022.92	4,668,045.44
1. 利息收入		109,717,536.40	5,516,662.29
其中：存款利息收入	6.4.3.11	77,687.57	13,665.83
债券利息收入		109,559,823.73	5,473,666.64
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		80,025.10	29,329.82
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,838,788.08	628,409.54
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13.1	11,838,788.08	628,409.54
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-12,932,296.07	-1,477,075.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	482,994.51	48.75
<b>减：二、费用</b>		13,214,492.62	655,969.58
1. 管理人报酬		5,031,554.27	228,044.66
2. 托管费		1,677,184.73	76,014.91
3. 销售服务费		975.04	74.18
4. 交易费用	6.4.3.18	102,768.00	3,250.96
5. 利息支出		5,435,995.33	179,665.35
其中：卖出回购金融资产支出		5,435,995.33	179,665.35
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.19	966,015.25	168,919.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		95,892,530.30	4,012,075.86
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		95,892,530.30	4,012,075.86

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金

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	11,490,496,236.80	93,603,189.21	11,584,099,426.01



金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	95,892,530.30	95,892,530.30
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)	-6,410,777,398.52	-61,685,584.61	-6,472,462,983.13
其中: 1. 基金申购款	307,143,203.40	3,747,092.66	310,890,296.06
2. 基金赎回款	-6,717,920,601.92	-65,432,677.27	-6,783,353,279.19
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)	-	-41,419,573.45	-41,419,573.45
五、期末所有者权益(基金净值)	5,079,718,838.28	86,390,561.45	5,166,109,399.73
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)	300,443,813.67	4,160,401.70	304,604,215.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,012,075.86	4,012,075.86
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)	-66,703.68	3,434.90	-63,268.78
其中: 1. 基金申购款	1,130,772.97	25,968.58	1,156,741.55
2. 基金赎回款	-1,197,476.65	-22,533.68	-1,220,010.33
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)	-	-4,417,171.74	-4,417,171.74
五、期末所有者权益(基金净值)	300,377,109.99	3,758,740.72	304,135,850.71

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: 佘方方

## 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[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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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费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	1,852,089.22
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,852,089.22

### 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	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	5,511,053,722.91	5,519,957,000.00
	合计	5,511,053,722.91	5,519,957,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	5,511,053,722.91	5,519,957,000.00	8,903,277.09

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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	294.52
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	-
应收债券利息	93,275,676.70
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	0.30
合计	93,275,971.52

#### 6.4.3.6 其他资产

无余额。

**6.4.3.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	77,685.95
合计	77,685.95

**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	-
应付证券出借违约金	-
其他应付款	20,000.00
应付指数使用费	838,592.39
预提费用	211,122.86
合计	1,069,715.25

**6.4.3.9 实收基金**
**博时中债 1-3 年国开行 A**

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	账面金额
上年度末	11,461,596,892.11	11,461,596,892.11
本期申购	306,458,141.46	306,458,141.46
本期赎回（以“-”号填列）	-6,688,641,602.42	-6,688,641,602.42
本期末	5,079,413,431.15	5,079,413,431.15

**博时中债 1-3 年国开行 C**

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	账面金额
上年度末	28,899,344.69	28,899,344.69
本期申购	685,061.94	685,061.94
本期赎回（以“-”号填列）	-29,278,999.50	-29,278,999.50
本期末	305,407.13	305,407.13

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）。

**6.4.3.10 未分配利润**
**博时中债 1-3 年国开行 A**

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	56,745,827.73	36,640,015.25	93,385,842.98
本期利润	108,800,061.32	-12,910,523.79	95,889,537.53
本期基金份额交易产生的变动数	-52,612,284.26	-8,860,056.64	-61,472,340.90
其中：基金申购款	3,363,117.73	375,351.71	3,738,469.44
基金赎回款	-55,975,401.99	-9,235,408.35	-65,210,810.34
本期已分配利润	-41,417,352.73	-	-41,417,352.73
本期末	71,516,252.06	14,869,434.82	86,385,686.88

**博时中债 1-3 年国开行 C**

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	124,998.53	92,347.70	217,346.23
本期利润	24,765.05	-21,772.28	2,992.77
本期基金份额交易产生的变动数	-143,560.19	-69,683.52	-213,243.71
其中：基金申购款	6,762.10	1,861.12	8,623.22
基金赎回款	-150,322.29	-71,544.64	-221,866.93
本期已分配利润	-2,220.72	-	-2,220.72
本期末	3,982.67	891.90	4,874.57

**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	77,652.75
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	29.22
其他	5.60
合计	77,687.57

**6.4.3.12 股票投资收益**
**6.4.3.12.1 股票投资收益项目构成**

无发生额。

**6.4.3.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

无发生额。

### 6.4.3.13 债券投资收益

#### 6.4.3.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,519,971,648.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,300,657,423.93
减：应收利息总额	207,475,436.73
买卖债券差价收入	11,838,788.08

#### 6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益

无发生额。

### 6.4.3.14 衍生工具收益

#### 6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

#### 6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

### 6.4.3.15 股利收益

无发生额。

### 6.4.3.16 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	-12,932,296.07
——股票投资	-
——债券投资	-12,932,296.07
——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	-12,932,296.07

**6.4.3.17 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	362,190.38
转换费收入	120,804.13
合计	482,994.51

**6.4.3.18 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	168.00
银行间市场交易费用	102,600.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	102,768.00

**6.4.3.19 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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
中债登账户维护费	9,000.00
指数使用费	838,592.39
上清所账户维护费	9,600.00
律师费	20,000.00
其他	7,000.00
合计	966,015.25

**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**

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

**6.4.4.2 资产负债表日后事项**

本基金的基金管理人于 2021 年 7 月 9 日宣告 2021 年度的第 3 次分红，向截至 2021 年 7 月 13 日止在本基金注册登记人博时基金管理有限公司登记在册的全体持有人，A 类份额按每 10 份基金份额发放红利 0.0700 元，C 类份额按每 10 份基金份额发放红利 0.0640 元。



#### 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、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司(“中国光大银行”)	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人的股东

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	5,031,554.27	228,044.66
其中：支付销售机构的客户维护费	93,980.38	142.97

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 0.15% 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 × 0.15% / 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	1,677,184.73	76,014.91

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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 × 0.05% / 当年天数。

###### 6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时中债 1-3 年国开行 A	博时中债 1-3 年国开行 C	合计
博时基金	-	917.59	917.59
光大银行	-	3.73	3.73
合计	-	921.32	921.32
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	博时中债 1-3 年国开行 A	博时中债 1-3 年国开行 C	合计
博时基金	-	23.11	23.11
合计	-	23.11	23.11

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
	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
光大银行	-	-	-	-	704,145,000.00	99,013.16
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
	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
光大银行	-	-	-	-	41,081,000.00	6,985.11

#### 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

##### 6.4.6.4.1 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。

##### 6.4.6.4.2 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。

#### 6.4.6.5 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**
**博时中债 1-3 年国开行 A**

份额单位：份

关联方名称	博时中债 1-3 年国开行 A 本期末 2021 年 6 月 30 日		博时中债 1-3 年国开行 A 上年度末 2020 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
光大银行	993,442,280.95	19.56%	993,442,280.95	8.65%

注：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。

**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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行-活 期存款	1,852,089.22	77,652.75	1,560,025.32	13,281.78

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。

**6.4.6.7 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**

无。

**6.4.7 利润分配情况**
**博时中债 1-3 年国开行 A**

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日 (场外)	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
1	2021-02-08	2021-02-08	0.0070	5,860,792.15	74.33	5,860,866.48	-
2	2021-05-07	2021-05-07	0.0700	35,556,124.21	362.04	35,556,486.25	-
合计			0.0770	41,416,916.36	436.37	41,417,352.73	-

**博时中债 1-3 年国开行 C**

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日 (场外)	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
1	2021-02-08	2021-02-08	0.0070	1,436.99	2.99	1,439.98	-
2	2021-05-07	2021-05-07	0.0610	720.41	60.33	780.74	-
合计			0.0680	2,157.40	63.32	2,220.72	-

#### 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

截至本报告期末 2021 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 396,168,101.90 元, 是以如下债券作为抵押:

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
160207	16 国开 07	2021-07-01	100.66	2,738,000.00	275,607,080.00
190214	19 国开 14	2021-07-06	100.38	1,087,000.00	109,113,060.00
210212	21 国开 12	2021-07-01	100.35	317,000.00	31,810,950.00
合计				4,142,000.00	416,531,090.00

###### 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

本基金为债券型指数基金, 属于中低风险收益水平, 其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金, 高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券。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紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.25%，年化跟踪误差控制在 3%以内。

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。

#### 6.4.9.2 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均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。

#### 6.4.9.2.1 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	-	-
未评级	-	1,512,567,000.00
合计	-	1,512,567,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

#### 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	-	-
未评级	5,519,957,000.00	9,398,729,680.00
合计	5,519,957,000.00	9,398,729,680.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的中期票据、地方政府债。

#### 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，因此账面余额约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》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、流通受限制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。

#### 6.4.9.4 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。

##### 6.4.9.4.1.1 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
<b>资产</b>					
银行存款	1,852,089.22		-	-	1,852,089.22
结算备付金	-		-	-	-
存出保证金	586.65		-	-	586.65
交易性金融资产	282,223,000.00	5,237,734,000.00	-	-	5,519,957,000.00
应收证券清算款	-		-	-	-
买入返售金融资产	-		-	-	-
应收利息	-		-	93,275,971.52	93,275,971.52
应收申购款	-		-	799.99	799.99
应收股利	-		-	-	-
其他资产	-		-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>284,075,675.87</b>	<b>5,237,734,000.00</b>	<b>-</b>	<b>93,276,771.51</b>	<b>5,615,086,447.38</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	396,168,101.90		-	-	396,168,101.90
应付赎回款	-		-	1,060.69	1,060.69
应付证券清算款	-		-	50,754,800.00	50,754,800.00
应付管理人报酬	-		-	635,630.90	635,630.90
应付托管费	-		-	211,876.98	211,876.98
应付销售服务费	-		-	17.64	17.64
应交税费	-		-	-	-
应付交易费用	-		-	77,685.95	77,685.95
应付利息	-		-	58,158.34	58,158.34
应付利润	-		-	-	-
其他负债	-		-	1,069,715.25	1,069,715.25
<b>负债总计</b>	<b>396,168,101.90</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>52,808,945.75</b>	<b>448,977,047.65</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>-112,092,426.03</b>	<b>5,237,734,000.00</b>	<b>-</b>	<b>40,467,825.76</b>	<b>5,166,109,399.73</b>
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年	不计息	合计

2020 年 12 月 31 日			以上		
<b>资产</b>					
银行存款	495,625,148.56	-	-	-	495,625,148.56
结算备付金	38,353.45	-	-	-	38,353.45
存出保证金	269.78	-	-	-	269.78
交易性金融资产	1,713,880,680.00	9,197,416,000.00	-	-	10,911,296,680.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	181,939,158.29	181,939,158.29
应收申购款	-	-	-	510.00	510.00
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>2,209,544,451.79</b>	<b>9,197,416,000.00</b>	-	<b>181,939,668.29</b>	<b>11,588,900,120.08</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	981.76	981.76
应付证券清算款	-	-	-	4,082,266.30	4,082,266.30
应付管理人报酬	-	-	-	304,340.20	304,340.20
应付托管费	-	-	-	101,446.74	101,446.74
应付销售服务费	-	-	-	169.60	169.60
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	56,336.87	56,336.87
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	255,152.60	255,152.60
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>4,800,694.07</b>	<b>4,800,694.07</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>2,209,544,451.79</b>	<b>9,197,416,000.00</b>	-	<b>177,138,974.22</b>	<b>11,584,099,426.01</b>

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

#### 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
	1. 市场利率下降 25 个基点	增加约 1,929	增加约 4,217
2. 市场利率上升 25 个基点	减少约 1,917	减少约 4,188	

#### 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。

#### 6.4.9.4.3 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。

##### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

##### 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 0.00 元，属于第二层次的余额为 5,519,957,000.00 元，属于第三层次的余额为 0.00 元（上年度末：第一层次 0.00 元，第二层次 10,911,296,680.00 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：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,519,957,000.00	98.31
	其中：债券	5,519,957,000.00	98.31
	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	1,852,089.22	0.03
8	其他各项资产	93,277,358.16	1.66
9	合计	5,615,086,447.38	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,519,957,000.00	106.85
	其中：政策性金融债	5,519,957,000.00	106.85
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,519,957,000.00	106.85

## 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	190214	19 国开 14	15,800,000	1,586,004,000.00	30.70
2	180204	18 国开 04	7,800,000	804,414,000.00	15.57
3	160207	16 国开 07	6,400,000	644,224,000.00	12.47
4	210212	21 国开 12	5,900,000	592,065,000.00	11.46
5	190407	19 农发 07	3,000,000	301,650,000.00	5.84

## 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 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。

## 7.11 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。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除 19 国开 14(190214)、18 国开 04(180204)、16 国开 07(160207)、21 国开 12(210212)、19 农发 07(190407)、15 国开 21(150221)、21 进出 12(210312)、20 国开 02(200202)、19 国开 07(190207)、17 国开 12(170212)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。

主要违规事实：2021 年 1 月 15 日，因存在项目融资业务管理严重违反审慎经营规则的违规行为，中国银行保险监督管理委员会北京监管局对国家开发银行北京分行处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2021 年 6 月 15 日，因存在一、项目调查审查不尽职；二、未能通过有效的内控措施发现并纠正员工违规保管客户物品的行为的违规行为，中国银保监会浙江监管局对中国农业发展银行浙江省分行处以罚款的处罚。

主要违规事实：2021 年 4 月 22 日，因存在贷款“三查”不到位的违规行为，中国银行保险监督管理委员会海南监管局对中国进出口银行海南省分行处以罚款的处罚。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

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	586.65
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	93,275,971.52
5	应收申购款	799.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	93,277,358.16

#### 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

份额级别	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
博时中债 1-3 年国开行 A	68	74,697,256.34	5,079,280,364.08	100.00%	133,067.07	0.00%
博时中债 1-3 年国开行 C	290	1,053.13	-	-	305,407.13	100.00%
合计	349	14,555,068.30	5,079,280,364.08	99.99%	438,474.20	0.01%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	博时中债 1-3 年国开行 A	314.27	0.00%
	博时中债 1-3 年国开行 C	-	-
	合计	314.27	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。



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时中债 1-3 年国开行 A	博时中债 1-3 年国开行 C
基金合同生效日（2019 年 4 月 22 日）基金份额总额	1,000,430,325.47	931,489.30
本报告期期初基金份额总额	11,461,596,892.11	28,899,344.69
本报告期基金总申购份额	306,458,141.46	685,061.94
减：本报告期基金总赎回份额	6,688,641,602.42	29,278,999.50
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,079,413,431.15	305,407.13

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票时间从 2020 年 12 月 28 日起，至 2021 年 1 月 28 日 17:00 止，会议审议通过了《关于博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金调整赎回费率的议案》。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

### 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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	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
长江证券	9,694,622.01	100.00%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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。

## 10.8 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	博时中债 1-3 年国开行债券指数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	2021-06-08
2	博时中债 1-3 年国开行债券指数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	2021-06-08
3	博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金更新招募说明书	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-06-08
4	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）》修改基金法律文件的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-06-08
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	证券日报、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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-26
7	博时中债 1-3 年国开行债券指数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	2021-04-30
8	博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-30
9	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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-28
10	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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-24
11	博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金 2021 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	2021-04-22

		网站	
12	博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金（博时中债 1-3 年国开行 A）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	2021-04-08
13	博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金（博时中债 1-3 年国开行 C）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	2021-04-08
14	博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金（博时中债 1-3 年国开行 A）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	2021-04-06
15	博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金（博时中债 1-3 年国开行 C）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	2021-04-06
16	博时基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金法律文件的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
17	博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金更新招募说明书	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
18	博时中债 1-3 年国开行债券指数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	2021-03-31
19	博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金 2020 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	2021-03-31
20	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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-30
21	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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-20
22	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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-10
23	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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-20
24	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	2021-02-06
25	博时中债 1-3 年国开行债券指数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	2021-02-04
26	博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基	证券日报、基金管理人网	2021-02-03

	金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	站、证监会基金电子披露网站	
27	博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金更新招募说明书	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-02
28	博时基金管理有限公司关于博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-02
29	博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金（博时中债 1-3 年国开行 A）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	2021-02-02
30	博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金（博时中债 1-3 年国开行 C）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	2021-02-02
31	博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金 2020 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	2021-01-22

## § 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%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	2021-03-04~2021-06-30	1,488,389,561.42	-	-	1,488,389,561.42	29.30%
	2	2021-01-15~2021-02-21	1,992,427,774.46	-	1,000,000,000.00	992,427,774.46	19.54%
	3	2021-01-15~2021-01-19	1,989,655,670.07	-	1,989,655,670.07	-	-

#### 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。

## 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中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时中债 1-3 年国开行债券指数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 博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金各年度审计报告正本
- 12.1.6 报告期内博时中债 1-3 年国开行债券指数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