

# 博时乐臻定期开放混合型证券投资基金 2020 年中期报告 2020 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：二〇二〇年八月三十一日

## § 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 2020 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 2020 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.....	4
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.....	5
<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.....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
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.....	10
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
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.....	10
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.....	10
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>10</b>
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	12
6.4 报表附注.....	14
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>29</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	29
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.....	30
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.....	34
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.....	34
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.....	34
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.....	35
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.....	35
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	35
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	35
7.12 投资组合报告附注.....	35
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>36</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	36
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	36
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.....	36
<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>37</b>

10.1 基金份额持有人大会决议 .....	37
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.....	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	37
10.4 基金投资策略的改变 .....	37
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	37
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>39</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.....	39
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	39
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>39</b>
12.1 备查文件目录 .....	39
12.2 存放地点 .....	39
12.3 查阅方式 .....	39

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时乐臻定期开放混合型证券投资基金
基金简称	博时乐臻定开混合
基金主代码	003331
交易代码	003331
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 29 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	1,005,470,093.02 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在谨慎投资的前提下，本基金力争超越业绩比较基准，追求基金资产的长期、稳健、持续增值。
投资策略	本基金的投资策略分为封闭期投资策略和开放期投资策略，其中封闭期的投资策略包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、中小企业私募债投资策略、杠杆投资策略、股票投资策略、金融衍生品投资策略；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×60%+沪深 300 指数×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金，属于中高风险/收益的产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	张燕
	联系电话	0755-83169999	0755-83199084
	电子邮箱	service@bosera.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	95555
传真		0755-83195140	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		518040	518040
法定代表人		江向阳	李建红

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com

基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处
------------	--------------

## 2.5 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（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	46,193,634.03
本期利润	51,514,968.20
加权平均基金份额本期利润	0.0512
本期加权平均净值利润率	4.12%
本期基金份额净值增长率	4.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	60,804,242.15
期末可供分配基金份额利润	0.0605
期末基金资产净值	1,271,101,221.61
期末基金份额净值	1.2642
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	26.42%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

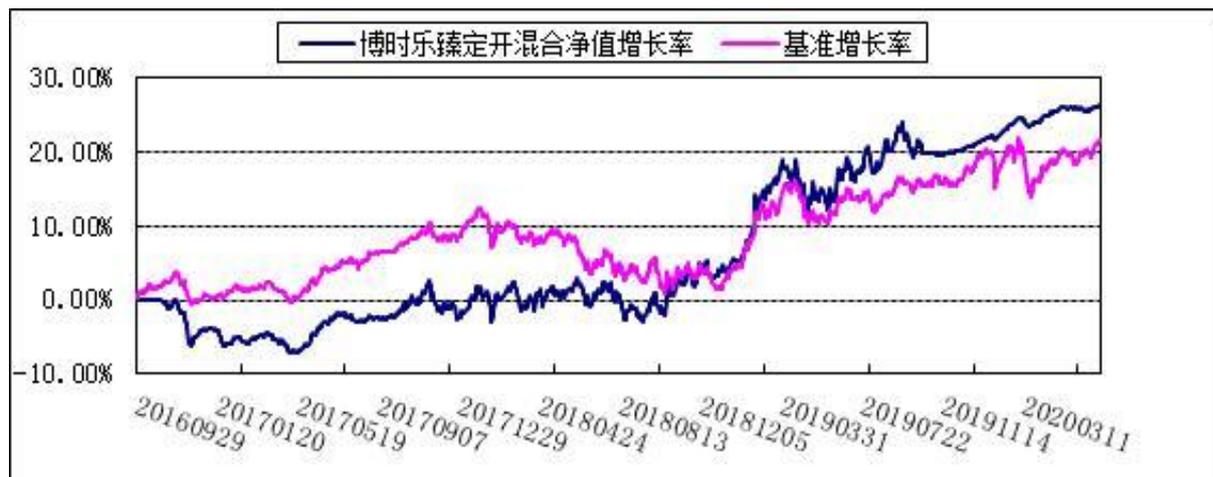
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.37%	0.10%	2.60%	0.36%	-2.23%	-0.26%
过去三个月	1.88%	0.10%	4.92%	0.37%	-3.04%	-0.27%
过去六个月	4.22%	0.11%	2.42%	0.59%	1.80%	-0.48%
过去一年	7.55%	0.35%	7.09%	0.47%	0.46%	-0.12%
过去三年	30.14%	0.55%	16.85%	0.49%	13.29%	0.06%
自基金合同生效起至今	26.42%	0.51%	21.86%	0.46%	4.56%	0.05%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数×60%+沪深 300 指数×40%

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 60%、40% 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



## § 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 2020 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 224 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 12150 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 3882 亿元人民币，累计分红逾 1296 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。

2020 年 6 月 29 日，《证券时报》第十五届中国基金业明星基金奖榜单公布，博时基金共荣获三项大奖，旗下产品博时外延增长主题混合与博时宏观回报债券分别拿下“三年持续回报平衡混合型明星基金”与“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。博时信用债券基金摘得“十年持续回报债券型明星基金”奖。

2020 年 4 月 1 日，博时基金及子公司博时国际荣获《亚洲资产管理》2020 “Best of the Best Awards” 三项大奖。博时基金董事长兼总经理江向阳荣获“中国年度最佳 CEO” (Winner, China CEO of the Year-Jiang Xiangyang)，博时基金（国际）有限公司荣获“香港最佳中资基金公司” (Winner, Hong Kong Best China Fund House)，博时信用债基金荣获“中国在岸人民币债券最佳业绩（5 年）” (Winner, CNY Bonds, Onshore 5 Years-Bosera Credit Bond Fund)。

2020 年 3 月 31 日，《中国证券报》第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，博时基金旗下绩优产品博时信用债纯债债券荣获“七年期开放式债券型持续优胜金牛基金奖”。

2020 年 3 月 26 日，Morningstar 晨星（中国）2020 年度基金评选结果揭晓，博时信用债券在参选的同类 428 只基金中脱颖而出，摘得晨星“2020 年度激进债券型基金奖”。

2020 年 1 月 10 日，新京报“开放 普惠 科技”2019 金融行业评选颁奖典礼在北京举办，博时基金凭借在可持续发展金融方面的努力成果，荣获“2019 年度杰出社会责任影响力企业”。

2020 年 1 月 4 日，2020《财经》可持续发展高峰论坛暨长青颁奖典礼在北京举办，博时基金凭借在 ESG 投资及可持续发展金融推动方面的耕耘和成果，荣获“2020《财经》长青奖-可持续发展创新奖”。

#### 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		
王申	固定收益总部 研究组负责人、研究组 总监/基金经理	2019-10-14	-	10.5	王申先生，博士。2002 年起先后在友邦保险、申银万国证券、国金证券工作。2013 年加入博时基金管理有限公司。历任固定收益研究主管、固定收益总部研究组副总监、博时锦禄纯债债券型证券投资基金(2016 年 11 月 8 日-2017 年 10 月 19 日)、博时民丰纯债债券型证券投资基金(2016 年 11 月 30 日-2017 年 12 月 29 日)、博时安慧 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2016 年 12 月 16 日-2017 年 12 月 29 日)、博时智臻纯债债券型证券投资基金(2016 年 8 月 30 日-2018 年 3 月 15 日)、博时民泽纯债债券型证券投资基金(2017 年 1 月 13 日-2018 年 3 月 15 日)、博时合惠货币市场基金(2017 年 1 月 13 日-2018 年 3 月 15 日)、博时富嘉纯债债券型证券投资基金(2017 年 1 月 20 日-2018 年 3 月 15 日)、博时汇享纯债债券型证券投资基金(2017 年 2 月 28 日-2018 年 3 月 15 日)、博时丰达纯债债券型证券投资基金(2016 年 11 月 8 日-2018 年 3 月 29 日)、博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 3 月 29 日-2018 年 4 月 23 日)、博时富鑫纯债债券型证券投资基金(2016 年 11 月 17 日-2018 年 7 月 16 日)、博时富腾纯债债券型证券投资基金(2017 年 6 月 27 日-2018 年 7 月 16 日)、博时盈海纯债债券型证券投资基金(2017 年 8 月 14 日-2018 年 7 月 19 日)、博时新财富混合型证券投资基金(2015 年 6 月 24 日-2018 年 8 月 9 日)、博时鑫禧灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 9 月 26 日-2018 年 9 月 27 日)、博时富祥纯债债券型证券投资基金(2018 年 10 月 29 日-2019 年 12 月 16 日)、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 12 月 7 日-2020 年 6

				月 4 日)、博时鑫泰灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 12 月 29 日-2020 年 6 月 4 日)的基金经理。现任固定收益总部研究组负责人、研究组总监兼博时宏观回报债券型证券投资基金(2015 年 5 月 22 日一至今)、博时乐臻定期开放混合型证券投资基金(2019 年 10 月 14 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(2019 年 12 月 19 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(2020 年 1 月 15 日一至今)、博时平衡配置混合型证券投资基金(2020 年 2 月 24 日一至今)、博时天颐债券型证券投资基金(2020 年 2 月 24 日一至今)、博时富灿纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2020 年 3 月 26 日一至今)、博时恒裕 6 个月持有期混合型证券投资基金(2020 年 5 月 18 日一至今)的基金经理。
--	--	--	--	--

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

#### 4.2 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 93 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

上半年权益市场整体呈现结构性行情，债券市场则在 5-6 月出现剧烈调整。2 季度操作上，组合在权益上继续保持高股息高 ROE 分散配置结合适度择时的风格，债券上保持短久期高静态。组合比较好的分享了权益市场的机会，同时债市的调整对组合的负面冲击有限，整体回撤可控，风格较为稳健。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.2642 元，份额累计净值为 1.2642 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 4.22%，同期业绩基准增长率 2.42%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，基本面方面，全球范围的复工复产在进行当中，国内经济高频数据有企稳好转的趋势。流动性总体宽裕，投资者情绪稳定且市场活跃度较高。在全球经济低增长运行、低通胀和低利率的环境中，大类资产上权益的相对价值明显，债券品种则需要继续控制久期风险，强调票息价值。A 股资产与全球市场的情况类似，投资者在追逐盈利稳定增长品种的同时，对估值的容忍度不断提高，对于商业赛道长、盈利稳定性以及成长的确定性给与更高估值。展望后市，国内经济 2 季度复工进展良好以及疫情控制较为得力是近期 A 股持续走强的基础。虽然世界范围内疫情仍具有不确定性，但是 A 股目前运行在国内经济修复趋势确立，货币政策保持友好的逻辑中，权益资产在大类资产中具有相对优势。叠加在全球范围内的低增长，“资产荒”背景下海外配置资金在人民币币值稳定的预期下持续流入。在基本面或者货币环境改变前，抱团与相关板块的估值扩张可能持续，但需要密切关注可能影响市场风格切换的重要变量。组合会继续保持自上而下对高股息高 ROE 品种的分散配置风格，并根据对市场性价比的判断进行适度择时。债券方面，5-6 月债市调整的主因是短端重定价。经过本轮调整，在货币政策大基调依旧保持宽松的情况下，短端调整基本到位，资金价格水平预计将在 2-2.3 的中枢趋于稳定。长端前期蕴含的流动性过度定价风险基本得到释放，后续基本面将成为长端主要的驱动因素。目前企业依旧面临较高的库存压力和盈利压力，短期内尚看不到明显的周期扩张动力。但是伴随 PPI 的反弹，企业盈利能力将在 4 季度逐步恢复，预计在今年 4 季度或年底到明年上半年，可能看到一轮比较明显的周期复苏，并可能在明年推动货币政策的实质性转向。基于这样的判断，我们对久期依旧保持谨慎，组合操作上会强调票息，久期交易会比较灵活并控制仓位。

## 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副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、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

本报告期内本基金未进行收益分配。

#### 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

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：博时乐臻定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.3.1	4,424,000.55	4,201,384.72
结算备付金		6,534,587.74	18,247,002.79
存出保证金		46,993.20	49,170.29
交易性金融资产	6.4.3.2	1,844,567,160.60	1,789,468,675.87
其中：股票投资		94,215,480.30	105,691,533.57
基金投资		-	-
债券投资		1,505,939,330.30	1,447,454,542.30
资产支持证券投资		244,412,350.00	236,322,600.00
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		5,513,014.50	-
应收利息	6.4.3.5	41,932,875.81	27,732,958.57
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>1,903,018,632.40</b>	<b>1,839,699,192.24</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 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		625,339,084.48	618,019,896.96
应付证券清算款		4,621,116.85	43,269.80
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		830,491.03	849,890.34
应付托管费		155,717.05	161,008.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	150,867.41	124,930.55
应交税费		226,023.96	226,934.38
应付利息		480,383.87	562,508.25
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	113,726.14	124,500.00
<b>负债合计</b>		<b>631,917,410.79</b>	<b>620,112,938.83</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.3.9	1,005,470,093.02	1,005,470,093.02
未分配利润	6.4.3.10	265,631,128.59	214,116,160.39
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,271,101,221.61</b>	<b>1,219,586,253.41</b>

负债和所有者权益总计		1,903,018,632.40	1,839,699,192.24
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2642 元，基金份额总额 1,005,470,093.02 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时乐臻定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>65,426,947.67</b>	<b>11,325,752.56</b>
1. 利息收入		44,948,091.18	1,251,504.34
其中：存款利息收入	6.4.3.11	116,478.45	42,180.50
债券利息收入		37,245,660.30	1,206,831.44
资产支持证券利息收入		7,575,440.21	-
买入返售金融资产收入		10,512.22	2,492.40
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		15,157,482.32	-5,175,339.26
其中：股票投资收益	6.4.3.12	14,124,620.22	5,646,703.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-970,497.59	-11,055,432.19
资产支持证券投资		-	-
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	2,003,359.69	233,389.52
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	5,321,334.17	15,249,587.48
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	40.00	-
<b>减：二、费用</b>		<b>13,911,979.47</b>	<b>1,151,271.78</b>
1. 管理人报酬		4,972,079.72	418,443.37
2. 托管费		932,264.94	83,688.72
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	409,681.51	88,775.73
5. 利息支出		7,297,912.69	477,674.96
其中：卖出回购金融资产支出		7,297,912.69	477,674.96
6. 税金及附加		161,216.42	629.34
7. 其他费用	6.4.3.19	138,824.19	82,059.66
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>51,514,968.20</b>	<b>10,174,480.78</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>51,514,968.20</b>	<b>10,174,480.78</b>

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时乐臻定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,005,470,093.02	214,116,160.39	1,219,586,253.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	51,514,968.20	51,514,968.20
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,005,470,093.02	265,631,128.59	1,271,101,221.61
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	75,074,893.49	3,003,418.07	78,078,311.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,174,480.78	10,174,480.78
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	75,074,893.49	13,177,898.85	88,252,792.34

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：王德英，会计机构负责人：成江

## 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[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 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 2020年6月30日
活期存款	4,424,000.55
定期存款	-
其他存款	-
合计	4,424,000.55

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	90,173,999.18	94,215,480.30	4,041,481.12
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	549,899,547.61	551,517,730.30
	银行间市场	947,811,446.03	954,421,600.00
	合计	1,497,710,993.64	1,505,939,330.30
资产支持证券	243,204,028.76	244,412,350.00	1,208,321.24
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,831,089,021.58	1,844,567,160.60	13,478,139.02

#### 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

无余额。

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	457.37
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	2,940.50
应收债券利息	37,544,778.49
应收资产支持证券利息	4,384,678.35
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	21.10
合计	41,932,875.81

**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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	136,012.15
银行间市场应付交易费用	14,855.26
合计	150,867.41

**6.4.3.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2020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	-
预提费用	113,726.14
合计	113,726.14

**6.4.3.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,005,470,093.02	1,005,470,093.02
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,005,470,093.02	1,005,470,093.02

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.3.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,610,608.12	199,505,552.27	214,116,160.39
本期利润	46,193,634.03	5,321,334.17	51,514,968.20
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,804,242.15	204,826,886.44	265,631,128.59

**6.4.3.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	25,537.52

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	90,440.27
其他	500.66
合计	116,478.45

#### 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	144,891,326.86
减：卖出股票成本总额	130,766,706.64
买卖股票差价收入	14,124,620.22

#### 6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	158,791,081.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	153,686,987.15
减：应收利息总额	6,074,592.34
买卖债券差价收入	-970,497.59

#### 6.4.3.14 衍生工具收益

无发生额。

#### 6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,003,359.69
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,003,359.69

#### 6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	5,321,334.17
——股票投资	128,197.37
——债券投资	5,103,386.80
——资产支持证券投资	89,750.00
——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	5,321,334.17

#### 6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	40.00
合计	40.00

注：无发生额。

#### 6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	406,239.01
银行间市场交易费用	3,442.50
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	409,681.51

#### 6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	12,598.05
中债登账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	12,800.00
合计	138,824.19

#### 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

截至财务报告批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

##### 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
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

###### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	-	-	64,916,389.88	100.00%

###### 6.4.6.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.6.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	-	-	135,119,064.30	96.40%

###### 6.4.6.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	-	-	3,844,458,000.00	100.00%

###### 6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额

	佣金	总量的比例		的比例
招商证券	47,472.67	100.00%	15,205.40	100.00%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,972,079.72	418,443.37
其中：支付销售机构的客户维护费	2,732,356.65	184,205.32

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 1.00% 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 X 1.00% / 当年天数。

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	932,264.94	83,688.72

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 X 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

##### 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

无。

#### 6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	4,424,000.55	25,537.52	1,067,921.26	6,867.16

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

**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**

无。

**6.4.8 期末（2020 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**

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601816	京沪高铁	2020-01-08	2020-07-16	首次公开发行限售	4.88	6.17	384,125.00	1,874,530.00	2,370,051.25	-
688278	特宝生物	2020-01-09	2020-07-17	首次公开发行限售	8.24	67.73	8,636.00	71,160.64	584,916.28	-
688520	神州细胞	2020-06-11	2020-12-22	首次公开发行限售	25.64	58.82	12,351.00	316,679.64	726,485.82	-
688312	燕麦科技	2020-05-29	2020-12-08	首次公开发行限售	19.68	41.77	7,390.00	145,435.20	308,680.30	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2021-01-04	首次公开发行限售	11.33	11.33	8,337.00	94,458.21	94,458.21	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股未上市	17.63	17.63	470.00	8,286.10	8,286.10	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新股未上市	12.04	12.04	8,810.00	106,072.40	106,072.40	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股未上市	10.01	10.01	751.00	7,517.51	7,517.51	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股未上市	16.42	16.42	7,894.00	129,619.48	129,619.48	-
688568	中科星图	2020-06-30	2021-01-08	首次公开发行限售	16.21	16.21	11,020.00	178,634.20	178,634.20	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股未上市	36.18	36.18	2,830.00	102,389.40	102,389.40	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新股未上市	15.50	15.50	5,468.00	84,754.00	84,754.00	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股未上市	3.37	3.37	1,131.00	3,811.47	3,811.47	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	5.94	5.94	1,185.00	7,038.90	7,038.90	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发

行股份,所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让;所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份,自发行结束之日起 6 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》,基金持有的上市公司非公开发行股份,自股份解除限售之日起 12 个月内,通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%(根据中国证监会《〈关于修改上市公司证券发行管理办法的决定〉〈关于修改创业板上市公司证券发行管理暂行办法的决定〉〈关于修改上市公司非公开发行股票实施细则的决定〉的立法说明》,基金持有的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份,不适用上述减持规则的相关规定);采取大宗交易方式的,在任意连续 90 日内,减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外,基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份,在受让后 6 个月内,不得转让所受让的股份。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》,基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的,锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。

4、本基金在持有上述受限证券期间,若获得送股配股等权益,其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

#### 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 2020 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 370,339,084.48 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
101901349	19 金阳投资 MTN001	2020-07-03	102.21	28,000.00	2,861,880.00
101900677	19 合川城投 MTN001	2020-07-03	104.92	49,000.00	5,141,080.00
011902469	19 海沧投资 SCP006	2020-07-03	100.55	60,000.00	6,033,000.00
101556045	15 宁经开 MTN001	2020-07-02	100.84	78,000.00	7,865,520.00
102000490	20 天恒基 MTN001	2020-07-03	97.78	100,000.00	9,778,000.00
102000960	20 绿原国资 MTN001	2020-07-03	98.80	100,000.00	9,880,000.00
012001951	20 镇江文旅 SCP003	2020-07-03	99.74	100,000.00	9,974,000.00
012001433	20 新业国资 SCP002	2020-07-03	99.82	100,000.00	9,982,000.00
012001501	20 镇江城建 SCP003	2020-07-03	100.06	100,000.00	10,006,000.00
012001535	20 镇江文旅 SCP002	2020-07-03	100.06	100,000.00	10,006,000.00
101901699	19 金霞经开 MTN001	2020-07-03	100.67	100,000.00	10,067,000.00
041900464	19 镇江交通 CP003	2020-07-03	101.06	100,000.00	10,106,000.00
101558041	15 浔富和 MTN001	2020-07-03	101.18	100,000.00	10,118,000.00
041900429	19 镇国投 CP004	2020-07-03	101.22	100,000.00	10,122,000.00
101901313	19 雅安 MTN001	2020-07-03	101.59	100,000.00	10,159,000.00
101900554	19 株洲高科 MTN001	2020-07-03	103.04	100,000.00	10,304,000.00
1980045	19 金霞经开债	2020-07-02	102.98	112,000.00	11,533,760.00
101556045	15 宁经开 MTN001	2020-07-03	100.84	122,000.00	12,302,480.00
101901332	19 北辰科技 MTN002	2020-07-03	101.27	190,000.00	19,241,300.00
011902476	19 镇江城建 SCP013	2020-07-03	100.64	200,000.00	20,128,000.00

101654043	16 望城经开 MTN002	2020-07-02	100.75	200,000.00	20,150,000.00
011902813	19 镇江交通 SCP004	2020-07-03	100.76	200,000.00	20,152,000.00
011902513	19 镇江交通 SCP003	2020-07-03	100.85	200,000.00	20,170,000.00
101573018	15 渝兴 MTN001	2020-07-02	101.32	200,000.00	20,264,000.00
1780213	17 株洲湘江债	2020-07-03	101.98	243,000.00	24,781,140.00
101900428	19 渝兴建投 MTN001	2020-07-02	103.39	300,000.00	31,017,000.00
1680393	16 高科专项债	2020-07-02	79.13	412,000.00	32,601,560.00
1980045	19 金霞经开债	2020-07-02	102.98	445,000.00	45,826,100.00
1680430	16 东台国资债	2020-07-02	78.87	600,000.00	47,322,000.00
合计				4,839,000.00	467,892,820.00

#### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本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 255,000,000.00 元，于 2020 年 07 月 07 日(先后)到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

#### 6.4.8.4 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

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中等收益/风险特征的基金。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。本基金通过对多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争超越业绩比较基准，追求基金资产的长期、稳健、持续增值。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，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，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
A-1	61,703,600.00	91,433,700.00
A-1 以下	-	-
未评级	180,878,000.00	182,564,600.00
合计	242,581,600.00	273,998,300.00

注：未评级债券为短期融资券。

##### 6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

##### 6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

##### 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 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
AAA	372,816,187.50	300,584,995.30
AAA 以下	890,541,542.80	872,871,247.00
未评级	-	-
合计	1,263,357,730.30	1,173,456,242.30

##### 6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
AAA	212,393,150.00	206,331,600.00
AAA 以下	32,019,200.00	29,991,000.00
未评级	-	-
合计	244,412,350.00	236,322,600.00

##### 6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

### 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约定开放日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。

2020年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有625,339,084.48元将在一个月以内到期且计息(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》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.8。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2020年6月30日，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2020年6月30日，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。

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

#### 6.4.9.4 市场风险

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

##### 6.4.9.4.1 利率风险

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

本基金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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	4,424,000.55	-	-	-	4,424,000.55
结算备付金	6,534,587.74	-	-	-	6,534,587.74
存出保证金	46,993.20	-	-	-	46,993.20
交易性金融资产	727,538,610.40	799,257,003.50	223,556,066.40	94,215,480.30	1,844,567,160.60
应收证券清算款	-	-	-	5,513,014.50	5,513,014.50
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	41,932,875.81	41,932,875.81
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>738,544,191.89</b>	<b>799,257,003.50</b>	<b>223,556,066.40</b>	<b>141,661,370.61</b>	<b>1,903,018,632.40</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	625,339,084.48	-	-	-	625,339,084.48
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	4,621,116.85	4,621,116.85
应付管理人报酬	-	-	-	830,491.03	830,491.03
应付托管费	-	-	-	155,717.05	155,717.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	226,023.96	226,023.96
应付交易费用	-	-	-	150,867.41	150,867.41
应付利息	-	-	-	480,383.87	480,383.87
其他负债	-	-	-	113,726.14	113,726.14
<b>负债总计</b>	<b>625,339,084.48</b>	-	-	<b>6,578,326.31</b>	<b>631,917,410.79</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>113,205,107.41</b>	<b>799,257,003.50</b>	<b>223,556,066.40</b>	<b>135,083,044.30</b>	<b>1,271,101,221.61</b>
上年度末 2019 年 12 月 31 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	4,201,384.72	-	-	-	4,201,384.72
结算备付金	18,247,002.79	-	-	-	18,247,002.79
存出保证金	49,170.29	-	-	-	49,170.29
交易性金融资产	621,305,300.00	859,310,800.00	203,161,042.30	105,691,533.57	1,789,468,675.87
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	27,732,958.57	27,732,958.57
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>643,802,857.80</b>	<b>859,310,800.00</b>	<b>203,161,042.30</b>	<b>133,424,492.14</b>	<b>1,839,699,192.24</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	618,019,896.96	-	-	-	618,019,896.96
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	43,269.80	43,269.80
应付管理人报酬	-	-	-	849,890.34	849,890.34
应付托管费	-	-	-	161,008.55	161,008.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	226,934.38	226,934.38
应付交易费用	-	-	-	124,930.55	124,930.55
应付利息	-	-	-	562,508.25	562,508.25
其他负债	-	-	-	124,500.00	124,500.00
<b>负债总计</b>	<b>618,019,896.96</b>	-	-	<b>2,093,041.87</b>	<b>620,112,938.83</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>25,782,960.84</b>	<b>859,310,800.00</b>	<b>203,161,042.30</b>	<b>131,331,450.27</b>	<b>1,219,586,253.41</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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 580	减少约 651
	市场利率下降 25 个基点	增加约 585	增加约 657

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	94,215,480.30	7.41	105,691,533.57	8.67
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,263,230.30	0.26	2,749,742.30	0.23
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	97,478,710.60	7.67	108,441,275.87	8.89

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2020年6月30日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为7.67%（2019年12月31日，8.89%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019年12月31日：同）。

#### 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2020年6月30日，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 92,765,995.28 元,属于第二层次的余额为 1,751,801,165.32 元,无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日:第一层次 107,568,697.83 元,第二层次 1,681,899,978.04 元,无第三层次)。

(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股票和债券,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 2020 年 6 月 30 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日: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	94,215,480.30	4.95
	其中:股票	94,215,480.30	4.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,750,351,680.30	91.98
	其中:债券	1,505,939,330.30	79.13
	资产支持证券	244,412,350.00	12.84
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	10,958,588.29	0.58
8	其他各项资产	47,492,883.51	2.50
9	合计	1,903,018,632.40	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	---------	---------------

A	农、林、牧、渔业	1,768,390.00	0.14
B	采矿业	3,092,163.00	0.24
C	制造业	48,121,533.21	3.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,277,374.32	0.57
E	建筑业	351,028.00	0.03
F	批发和零售业	2,794,765.00	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	6,001,076.00	0.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,218,175.77	0.25
J	金融业	13,365,143.00	1.05
K	房地产业	7,031,649.00	0.55
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	332,724.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	861,459.00	0.07
	合计	94,215,480.30	7.41

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600585	海螺水泥	58,700	3,105,817.00	0.24
2	601166	兴业银行	151,600	2,392,248.00	0.19
3	600048	保利地产	161,000	2,379,580.00	0.19
4	601816	京沪高铁	384,750	2,373,945.00	0.19
5	600519	贵州茅台	1,600	2,340,608.00	0.18
6	600276	恒瑞医药	24,000	2,215,200.00	0.17
7	600887	伊利股份	60,500	1,883,365.00	0.15
8	601006	大秦铁路	239,900	1,688,896.00	0.13
9	601636	旗滨集团	281,100	1,664,112.00	0.13
10	603239	浙江仙通	110,300	1,634,646.00	0.13
11	601688	华泰证券	86,000	1,616,800.00	0.13
12	601398	工商银行	305,100	1,519,398.00	0.12
13	603858	步长制药	51,100	1,474,235.00	0.12
14	601088	中国神华	101,300	1,454,668.00	0.11
15	600380	健康元	88,500	1,437,240.00	0.11
16	600305	恒顺醋业	74,382	1,379,786.10	0.11
17	600598	北大荒	83,900	1,350,790.00	0.11
18	600066	宇通客车	104,600	1,276,120.00	0.10
19	603699	纽威股份	81,600	1,271,328.00	0.10
20	600309	万华化学	24,900	1,244,751.00	0.10
21	600720	祁连山	72,200	1,173,250.00	0.09
22	600655	豫园股份	131,700	1,166,862.00	0.09
23	600642	申能股份	189,000	1,116,990.00	0.09
24	600761	安徽合力	115,100	1,109,564.00	0.09

25	300033	同花顺	8,300	1,104,564.00	0.09
26	600741	华域汽车	51,300	1,066,527.00	0.08
27	601717	郑煤机	180,900	1,065,501.00	0.08
28	600900	长江电力	55,500	1,051,170.00	0.08
29	601369	陕鼓动力	166,700	1,048,543.00	0.08
30	600657	信达地产	252,500	1,040,300.00	0.08
31	603669	灵康药业	130,760	1,031,696.40	0.08
32	603167	渤海轮渡	130,400	1,022,336.00	0.08
33	603993	洛阳钼业	277,300	1,017,691.00	0.08
34	600308	华泰股份	221,200	1,017,520.00	0.08
35	603968	醋化股份	69,900	1,010,055.00	0.08
36	603360	百傲化学	51,800	1,006,474.00	0.08
37	600021	上海电力	134,500	995,300.00	0.08
38	600919	江苏银行	174,600	989,982.00	0.08
39	600449	宁夏建材	80,600	984,932.00	0.08
40	601991	大唐发电	465,100	981,361.00	0.08
41	600886	国投电力	124,600	979,356.00	0.08
42	600808	马钢股份	378,700	977,046.00	0.08
43	600901	江苏租赁	185,800	968,018.00	0.08
44	601009	南京银行	128,900	944,837.00	0.07
45	601326	秦港股份	364,900	915,899.00	0.07
46	601939	建设银行	144,600	912,426.00	0.07
47	601601	中国太保	33,200	904,700.00	0.07
48	601997	贵阳银行	125,900	901,444.00	0.07
49	600153	建发股份	111,100	899,910.00	0.07
50	600603	广汇物流	182,900	861,459.00	0.07
51	600660	福耀玻璃	39,400	822,278.00	0.06
52	601318	中国平安	11,500	821,100.00	0.06
53	603696	安记食品	55,664	802,674.88	0.06
54	300059	东方财富	36,600	739,320.00	0.06
55	002241	歌尔股份	25,000	734,000.00	0.06
56	600511	国药股份	17,900	727,993.00	0.06
57	688520	神州细胞	12,351	726,485.82	0.06
58	000002	万科 A	27,600	721,464.00	0.06
59	002410	广联达	10,000	697,000.00	0.05
60	600177	雅戈尔	115,600	688,976.00	0.05
61	601229	上海银行	78,900	654,870.00	0.05
62	300383	光环新网	24,000	625,680.00	0.05
63	600104	上汽集团	35,700	606,543.00	0.05
64	300659	中孚信息	10,000	600,200.00	0.05
65	000063	中兴通讯	14,900	597,937.00	0.05
66	000011	深物业 A	36,700	587,200.00	0.05
67	688278	特宝生物	8,636	584,916.28	0.05
68	603019	中科曙光	15,200	583,680.00	0.05
69	300567	精测电子	8,500	580,125.00	0.05
70	000625	长安汽车	51,900	570,900.00	0.04
71	002385	大北农	62,100	565,731.00	0.04
72	600426	华鲁恒升	31,500	556,920.00	0.04
73	000600	建投能源	99,700	507,473.00	0.04
74	000778	新兴铸管	147,000	504,210.00	0.04

75	000883	湖北能源	141,600	498,432.00	0.04
76	000690	宝新能源	104,300	492,296.00	0.04
77	000703	恒逸石化	53,800	491,194.00	0.04
78	000965	天保基建	149,500	485,875.00	0.04
79	000006	深振业 A	70,900	482,829.00	0.04
80	002299	圣农发展	14,400	417,600.00	0.03
81	000877	天山股份	27,600	416,760.00	0.03
82	300741	华宝股份	11,300	416,744.00	0.03
83	000513	丽珠集团	8,300	398,483.00	0.03
84	000989	九芝堂	38,700	390,096.00	0.03
85	002601	龙蟠佰利	20,000	370,000.00	0.03
86	000708	中信特钢	21,605	369,229.45	0.03
87	002443	金洲管道	53,100	361,611.00	0.03
88	000036	华联控股	80,600	354,640.00	0.03
89	000090	天健集团	50,800	351,028.00	0.03
90	001696	宗申动力	54,200	349,048.00	0.03
91	002318	久立特材	46,800	341,640.00	0.03
92	002146	荣盛发展	41,700	337,770.00	0.03
93	000656	金科股份	41,300	337,008.00	0.03
94	000591	太阳能	99,100	334,958.00	0.03
95	002116	中国海诚	47,600	332,724.00	0.03
96	002540	亚太科技	76,900	331,439.00	0.03
97	000488	晨鸣纸业	66,619	329,097.86	0.03
98	000937	冀中能源	108,200	326,764.00	0.03
99	300193	佳士科技	45,600	326,040.00	0.03
100	000338	潍柴动力	23,400	321,048.00	0.03
101	688312	燕麦科技	7,390	308,680.30	0.02
102	000544	中原环保	47,200	307,272.00	0.02
103	000718	苏宁环球	98,700	304,983.00	0.02
104	000157	中联重科	45,900	295,137.00	0.02
105	601899	紫金矿业	66,600	293,040.00	0.02
106	002688	金河生物	43,000	291,540.00	0.02
107	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
108	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01
109	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.01
110	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.01
111	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.01
112	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.01
113	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.01
114	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
115	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
116	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
117	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
118	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
119	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
120	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

## 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601816	京沪高铁	2,677,900.00	0.22
2	603239	浙江仙通	1,499,235.00	0.12
3	688169	石头科技	1,459,167.84	0.12
4	002410	广联达	1,410,600.00	0.12
5	000002	万科 A	1,395,701.00	0.11
6	300033	同花顺	1,206,325.00	0.10
7	300567	精测电子	1,141,555.00	0.09
8	600305	恒顺醋业	1,108,052.84	0.09
9	603001	奥康国际	1,047,999.00	0.09
10	600603	广汇物流	1,047,762.00	0.09
11	603788	宁波高发	1,047,761.00	0.09
12	603669	灵康药业	1,047,549.45	0.09
13	000090	天健集团	1,047,475.00	0.09
14	600479	千金药业	1,047,263.00	0.09
15	600380	健康元	1,046,687.61	0.09
16	603167	渤海轮渡	1,038,463.00	0.09
17	601838	成都银行	1,038,035.00	0.09
18	603800	道森股份	1,037,500.00	0.09
19	600663	陆家嘴	1,037,086.16	0.09
20	603878	武进不锈	1,036,644.40	0.08

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688396	华润微	3,302,505.27	0.27
2	688169	石头科技	2,666,955.00	0.22
3	601601	中国太保	2,277,556.00	0.19
4	688126	沪硅产业	2,114,377.62	0.17
5	000090	天健集团	1,978,709.00	0.16
6	688177	百奥泰	1,873,082.10	0.15
7	688599	天合光能	1,839,239.13	0.15
8	601211	国泰君安	1,770,631.00	0.15
9	002318	久立特材	1,540,475.00	0.13
10	688158	优刻得	1,455,432.26	0.12
11	600057	厦门象屿	1,444,989.28	0.12
12	000718	苏宁环球	1,402,418.70	0.11
13	600276	恒瑞医药	1,394,925.92	0.11
14	000002	万科 A	1,369,929.00	0.11
15	600377	宁沪高速	1,358,667.00	0.11
16	601567	三星医疗	1,339,005.00	0.11
17	600548	深高速	1,337,424.00	0.11

18	600519	贵州茅台	1,327,478.00	0.11
19	002128	露天煤业	1,319,330.00	0.11
20	002242	九阳股份	1,296,903.00	0.11

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	119,162,456.00
卖出股票的收入（成交）总额	144,891,326.86

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	902,599,000.00	71.01
5	企业短期融资券	242,581,600.00	19.08
6	中期票据	357,495,500.00	28.12
7	可转债（可交换债）	3,263,230.30	0.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,505,939,330.30	118.48

### 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	163015	19 碧地 03	1,000,000	101,680,000.00	8.00
2	1980045	19 金霞经开债	600,000	61,788,000.00	4.86
3	112315	16 宝龙债	500,000	50,550,000.00	3.98
4	1680430	16 东台国资债	600,000	47,322,000.00	3.72
5	041900416	19 镇江交通 CP002	410,000	41,475,600.00	3.26

### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	156705	时代优 A	600,000.00	60,384,000.00	4.75
2	165131	19 奥通优	600,000.00	59,892,000.00	4.71
3	139857	华联 05 优	400,000.00	40,480,000.00	3.18
4	165143	联中 08 优	300,000.00	30,009,000.00	2.36
5	165375	19 中骏 1A	290,000.00	29,107,300.00	2.29

6	138247	粤湾 01 优	165,000.00	16,547,850.00	1.30
7	165907	滇中 2 优 A	60,000.00	5,982,000.00	0.47
8	138424	禹洲 3 优	20,000.00	2,010,200.00	0.16

### 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 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 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	46,993.20
2	应收证券清算款	5,513,014.50
3	应收股利	-
4	应收利息	41,932,875.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,492,883.51

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110059	浦发转债	706,839.00	0.06
2	128085	鸿达转债	317,163.20	0.02
3	110062	烽火转债	299,304.00	0.02
4	128084	木森转债	288,934.80	0.02

5	128080	顺丰转债	245,979.00	0.02
6	128081	海亮转债	234,746.20	0.02
7	113029	明阳转债	216,348.30	0.02
8	113554	仙鹤转债	132,631.20	0.01
9	110061	川投转债	127,012.00	0.01
10	113551	福特转债	116,810.40	0.01
11	110060	天路转债	49,539.60	0.00
12	113545	金能转债	32,194.40	0.00
13	113030	东风转债	30,514.40	0.00
14	128075	远东转债	16,521.40	0.00
15	113021	中信转债	15,703.50	0.00

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601816	京沪高铁	2,370,051.25	0.19	首次公开发行限售

### 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
17,859	56,300.47	-	-	1,005,470,093.02	100.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：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、本基金基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 9 月 29 日）基金份额总额	797,100,168.21
本报告期期初基金份额总额	1,005,470,093.02
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,005,470,093.02

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：1、基金管理人于 2020 年 1 月 10 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》，张光华先生不再担任公司董事长职务，由公司总经理江向阳先生代为履行董事长职务。2、基金管理人于 2020 年 4 月 17 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》，江向阳先生任博时基金管理有限公司董事长。

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 报告期内改聘会计师事务所情况

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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	
中信建投	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	147,101,301.15	59.07%	107,586.82	59.07%	-
中泰证券	1	101,928,754.48	40.93%	74,547.09	40.93%	-
国泰君安	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，我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
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	10,107,460.00	50.03%	6,207,900,000.00	67.11%	-	-
中泰证券	10,093,447.95	49.97%	3,043,080,000.00	32.89%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

### 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暂停使用中国银行理财直付服务办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
2	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
3	关于博时旗下部分基金参加招商银行申购及定投业务费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-01
4	博时乐臻定期开放混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-04-22
5	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-04-17

		露网	
6	博时乐臻定期开放混合型证券投资基金 2019 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-03-27
7	博时基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间暂停办理申购赎回等业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-28
8	博时乐臻定期开放混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-17

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时乐臻定期开放混合型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时乐臻定期开放混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时乐臻定期开放混合型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 博时乐臻定期开放混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 12.1.6 报告期内博时乐臻定期开放混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，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  
二〇二〇年八月三十一日