

# 博时亚洲票息收益债券型证券投资基金

## 2025 年中期报告

### 2025 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：二〇二五年八月二十九日

## § 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 2025 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 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
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 境外资产托管人	5
2.5 信息披露方式	5
2.6 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.9 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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	38
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	38
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	38
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	39
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	39

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	40
7.11 投资组合报告附注 .....	40
§ 8 基金份额持有人信息 .....	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	41
§ 9 开放式基金份额变动 .....	41
§ 10 重大事件揭示 .....	42
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
10.4 基金投资策略的改变 .....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	42
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 .....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.8 其他重大事件 .....	44
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	45
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	45
§ 12 备查文件目录 .....	45
12.1 备查文件目录 .....	45
12.2 存放地点 .....	46
12.3 查阅方式 .....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时亚洲票息收益债券型证券投资基金	
基金简称	博时亚洲票息收益债券	
基金主代码	050030	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 2 月 1 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,009,797,439.49 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时亚洲票息收益债券 A	博时亚洲票息收益债券 C
下属分级基金的交易代码	050030	019480
报告期末下属分级基金的份额总额	1,310,529,118.11 份	2,699,268,321.38 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过分析亚洲区域各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面，寻找各类债券的投资机会，在谨慎投资的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金主要采取资产配置策略、债券投资策略、基金投资策略和金融衍生品投资策略。资产配置策略指本基金密切跟踪相关国家或地区经济的景气周期以及财政、货币政策变化，把握市场利率水平的运行态势，从宏观层面了解亚洲各国家、行业的景气情况、防范系统性的宏观经济、政治以及信用风险，从而确定基金资产在不同国家、不同行业以及不同债券品种之间的配置比例。债券投资策略主要是指买入持有策略和信用策略。基金投资策略主要是指本基金投资债券基金等固定收益类基金。金融衍生品投资策略是指本基金主要投资于在经中国证监会认可的交易所上市交易的金融衍生品，当这些交易所没有本基金需要的衍生产品时，在严格风险控制的前提下，本基金将采用场外交易市场（OTC）买卖衍生产品。
业绩比较基准	JPMorganAsianCreditIndexCompositeTotalReturn
风险收益特征	本基金属于债券型基金，主要投资于亚洲市场的各类债券，预期收益和风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中等风险/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	姓名	吴曼	张姗

责人	联系电话	0755-83169999	400-61-95555
	电子邮箱	service@bosera.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	400-61-95555
传真		0755-83195140	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		518040	518040
法定代表人		江向阳	缪建民

## 2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Brown Brothers Harriman Co.
	中文	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-
办公地址		-
邮政编码		-

注：本基金未聘请境外投资顾问。

## 2.5 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	<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

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市东城区建国门内大街8号中粮广场C座3层301

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）	
	博时亚洲票息收益债券 A	博时亚洲票息收益债券 C
本期已实现收益	28,245,230.86	43,807,676.98
本期利润	38,266,286.08	61,913,688.38

加权平均基金份额本期利润	0.0298	0.0309
本期加权平均净值利润率	2.03%	2.11%
本期基金份额净值增长率	2.08%	2.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	博时亚洲票息收益债券 A	博时亚洲票息收益债券 C
期末可供分配利润	428,576,513.41	878,901,453.21
期末可供分配基金份额利润	0.3270	0.3256
期末基金资产净值	1,940,872,770.87	3,993,686,576.79
期末基金份额净值	1.4810	1.4795
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	博时亚洲票息收益债券 A	博时亚洲票息收益债券 C
基金份额累计净值增长率	68.92%	7.89%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时亚洲票息收益债券 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	0.71%	0.12%	0.79%	0.14%	-0.08%	-0.02%
过去三个月	0.19%	0.23%	1.22%	0.28%	-1.03%	-0.05%
过去六个月	2.08%	0.18%	3.40%	0.24%	-1.32%	-0.06%
过去一年	4.69%	0.21%	7.24%	0.23%	-2.55%	-0.02%
过去三年	11.62%	0.25%	24.90%	0.28%	-13.28%	-0.03%
自基金合同生效起至今	68.92%	0.27%	68.78%	0.27%	0.14%	0.00%

博时亚洲票息收益债券 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	0.71%	0.12%	0.79%	0.14%	-0.08%	-0.02%
过去三个月	0.18%	0.23%	1.22%	0.28%	-1.04%	-0.05%
过去六个月	2.08%	0.18%	3.40%	0.24%	-1.32%	-0.06%
过去一年	4.68%	0.21%	7.24%	0.23%	-2.56%	-0.02%

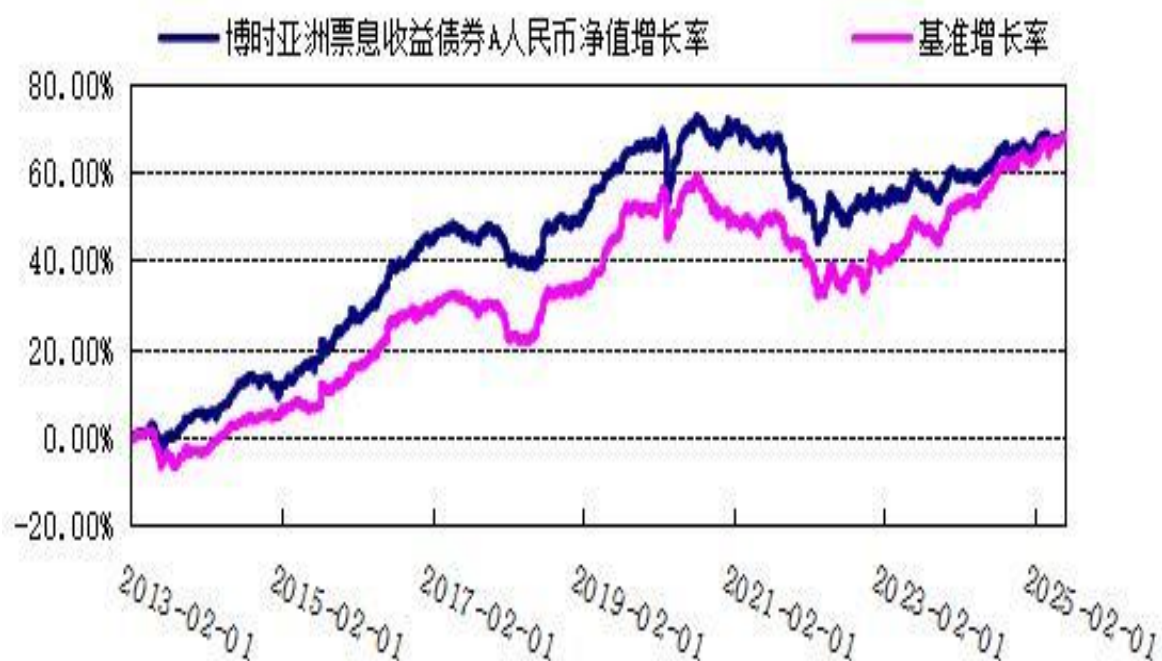
自基金合同生效起至今	7.89%	0.21%	15.01%	0.23%	-7.12%	-0.02%
------------	-------	-------	--------	-------	--------	--------

注：本基金的业绩比较基准为：JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return

### 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

博时亚洲票息收益债券 A

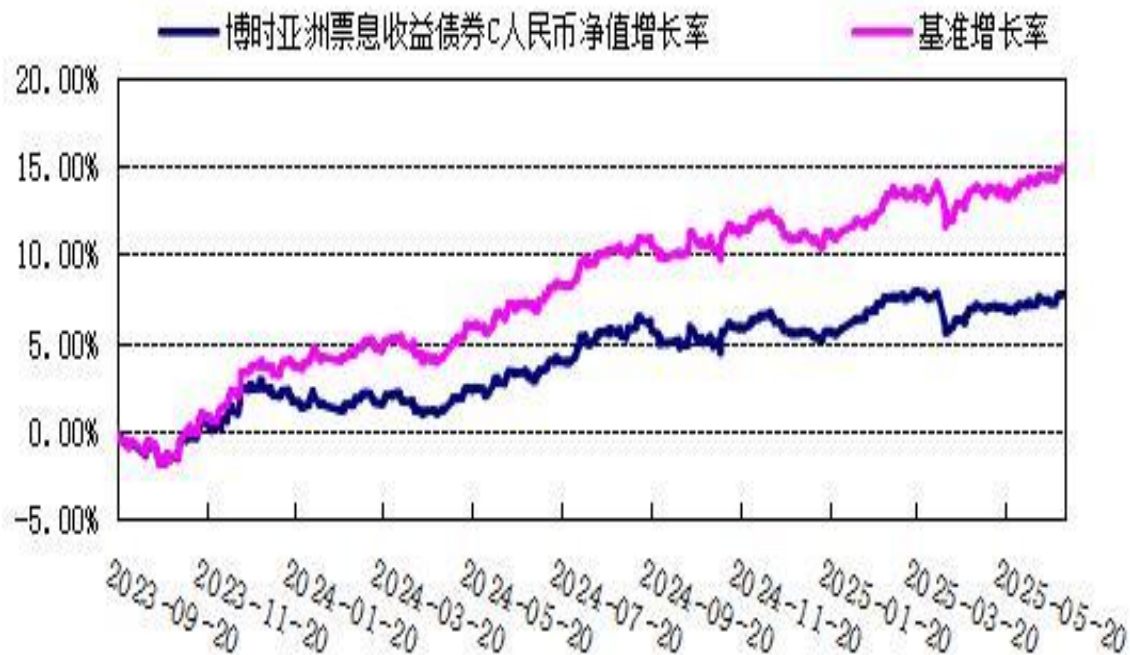
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



博时亚洲票息收益债券 C

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图





## § 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”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2025 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 394 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 16,069 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,729 亿元人民币，累计分红逾 2,186 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

#### 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		
何凯	固定收益投资三部投资总监 / 基金经理	2014-04-02	—	18.8	何凯先生，双硕士。CFA，2006 年起先后在荷兰银行（伦敦），中国投资有限责任公司、南方东英资产管理

					有限公司从事投资研究工作。2012 年 12 月加入博时基金管理有限公司。历任国际投资部副总经理、国际投资部副总经理兼基金经理助理、固定收益总部国际组投资副总监兼基金经理助理、固定收益总部国际组投资副总监、固定收益总部国际组负责人、投资总监。现任固定收益投资三部投资总监兼博时亚洲票息收益债券型证券投资基金(2014 年 4 月 2 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

#### 4.3 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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

##### 4.4.2 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 23 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。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，美国经济政策，美国利率以及风险资产走势都发生了剧烈变化，呈现出 V 型反转的动态。一季度，特朗普上台后推行的政策与市场之前的预期有所偏离，财政上更有紧缩倾向，美国经济数据也是先强后弱，使得市场对美联储今年的降息预期大幅增强，美债利率整体下行，但曲线斜率变化不大。全球信用利差走阔，全球股市下行，大宗商品在黄金和铜的带动下大幅上行，黄金续创历史新高。二季度伊始，特朗普在“解放日”宣布的全球关税政策造成市场大幅动荡，包括权益、信用等在内的风险资产显著回调，但后续关税政策缓和，经济基本面显示出韧性，美国重新回归扩张性财政政策，权益资产创出新高，信用利差重回历史低位。美元和美债的走势在本轮市场动荡中与历史规律背道而驰，此次更多体现出风险资产而非避险资产的特性：美元一路走低，初期美债利率一度快速下行，然而市场迅速对于美国长期信用受损定价，长期限美债利率不降反升，而后维持高位。美元和美债的走势都体现出全球资金对于美国自身政策不稳定性和长期偿付能力的担心，是全球资金再平衡的一个结果。美国经济数据总体显示出一定韧性，然其并非市场走势的关键影响因素。大宗商品在二季度整体下行，黄金作为在动荡市场中难得的全球性共识续创历史新高后维持高位震荡。

受益于票息收入和一定的资本利得，上半年亚洲债券市场表现较好，其中投资级债券表现强于高收益。从区域上看，马尔代夫、巴基斯坦、斯里兰卡表现最强；蒙古，中国香港、中国台湾表现最弱。

在基金的操作上，我们的配置集中在中短久期高等级信用债，一定程度配置超长期美国国债，

但受到低配信用久期和超配超长期美国国债的拖累，整体表现弱于基准。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 06 月 30 日，本基金 A 基金份额净值为 1.4810 元，份额累计净值为 1.6235 元，本基金 C 基金份额净值为 1.4795 元，份额累计净值为 1.4795 元，报告期内，本基金 A 基金份额净值增长率为 2.08%，本基金 C 基金份额净值增长率为 2.08%，同期业绩基准增长率为 3.40%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

特朗普关税政策在上半年快结束时一度缓和，对市场的影响有所消退，全球权益资产创出新高，信用利差回到历史低位，未来预计风险资产总体估值高位震荡。而本轮受冲击最大的美元和美债，则持续会受到市场对美国政策不稳定性和其长期信用的担忧影响，恐难以有趋势性表现。继续维持中短端高质量债券的配置，对长久期标的保持谨慎，仅做交易性考虑。此外，一些中资的高质量平衡型可转债性价比较高，具有配置价值。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。为确保基金估值工作符合以上规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人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、法律合规部负责人、风险管理部负责人、投资部门负责人、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备良好专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会负责制订健全、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，保证基金估值的公平、合理。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金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，当对估值原则及技术存有异议时，本基金托管人有责任要求本基金管理人作出合理解释，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、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：博时亚洲票息收益债券型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.6.1	361,771,346.29	79,793,063.19

结算备付金		5,425,015.22	6,904,741.72
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.6.2	5,802,665,971.81	4,121,512,615.67
其中：股票投资		-	-
基金投资		82,127,038.50	-
债券投资		5,337,120,811.52	4,121,512,615.67
资产支持证券投资		383,418,121.79	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.6.5	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		9,099,754.44	64,642,924.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	4,025,504.00
资产总计		6,178,962,087.76	4,276,878,849.55
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年6月30日</b>	<b>上年度末 2024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	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		199,318,081.70	-
应付赎回款		39,418,915.47	24,298,505.60
应付管理人报酬		3,745,442.85	2,780,890.75
应付托管费		1,170,450.89	869,028.39
应付销售服务费		30,964.98	19,190.14
应付投资顾问费		-	-
应交税费		619,883.86	457,467.71
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.7	99,000.35	187,040.25
负债合计		244,402,740.10	28,612,122.84
<b>净资产：</b>		-	-
实收基金	6.4.6.8	4,009,797,439.49	2,929,823,899.63



其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.9	1,924,761,908.17	1,318,442,827.08
净资产合计		5,934,559,347.66	4,248,266,726.71
负债和净资产总计		6,178,962,087.76	4,276,878,849.55

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 4,009,797,439.49 份。其中 A 类基金份额净值 1.4810 元，基金份额总额 1,310,529,118.11 份；C 类基金份额净值 1.4795 元，基金份额总额 2,699,268,321.38 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时亚洲票息收益债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至2025 年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
<b>一、营业总收入</b>		125,784,036.67	42,260,160.49
1. 利息收入		101,816.14	52,336.55
其中：存款利息收入	6.4.6.10	101,816.14	52,336.55
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		107,548,976.75	68,954,396.85
其中：股票投资收益	6.4.6.11	-	-
基金投资收益	6.4.6.12	-4,241,740.63	-
债券投资收益	6.4.6.13	109,388,402.77	69,999,370.21
资产支持证券投资收益	6.4.6.14	2,190,440.66	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.15	-1,298,644.27	-1,044,973.36
股利收益	6.4.6.16	1,510,518.22	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	28,127,066.62	-7,130,063.13
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-11,218,178.11	-21,339,985.27
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	1,224,355.27	1,723,475.49
<b>减：二、营业总支出</b>		25,604,062.21	15,763,832.05
1. 管理人报酬		19,047,617.39	11,695,894.15

其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		5,952,380.45	3,654,966.95
3. 销售服务费		144,841.00	93,223.87
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.6.19	-	-
7. 税金及附加		337,992.19	214,830.38
8. 其他费用	6.4.6.20	121,231.18	104,916.70
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		100,179,974.46	26,496,328.44
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		100,179,974.46	26,496,328.44
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		100,179,974.46	26,496,328.44

### 6.3 净资产变动表

会计主体：博时亚洲票息收益债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,929,823,899.63	-	1,318,442,827.08	4,248,266,726.71
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,929,823,899.63	-	1,318,442,827.08	4,248,266,726.71
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	1,079,973,539.86	-	606,319,081.09	1,686,292,620.95
（一）、综合收益总额	-	-	100,179,974.46	100,179,974.46
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减	1,079,973,539.86	-	506,139,106.63	1,586,112,646.49



少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	1, 583, 734, 103. 60	-	738, 625, 117. 55	2, 322, 359, 221. 15
2. 基金赎回款	-503, 760, 563. 74	-	-232, 486, 010. 92	-736, 246, 574. 66
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4, 009, 797, 439. 49	-	1, 924, 761, 908. 17	5, 934, 559, 347. 66
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1, 332, 510, 851. 38	-	540, 373, 834. 07	1, 872, 884, 685. 45
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1, 332, 510, 851. 38	-	540, 373, 834. 07	1, 872, 884, 685. 45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1, 041, 351, 800. 70	-	442, 422, 902. 45	1, 483, 774, 703. 15
(一)、综合收益总额	-	-	26, 496, 328. 44	26, 496, 328. 44
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1, 041, 351, 800. 70	-	415, 926, 574. 01	1, 457, 278, 374. 71
其中:1. 基金申购款	1, 367, 520, 012. 29	-	545, 612, 632. 68	1, 913, 132, 644. 97
2. 基金赎回款	-326, 168, 211. 59	-	-129, 686, 058. 67	-455, 854, 270. 26
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2, 373, 862, 652. 08	-	982, 796, 736. 52	3, 356, 659, 388. 60

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：陈子成

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

博时亚洲票息收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]7 号《关于核准博时亚洲票息收益债券型证券投资基金募集的批复》核准，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时亚洲票息收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,790,315,346.85 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字（2013）第 21 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时亚洲票息收益债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 2 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,790,533,225.99 份基金份额，其中认购资金利息折合 217,879.14 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行。

本基金根据申购费用与销售服务费收取方式等不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金自 2023 年 9 月 19 日起增加 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。在投资者申购时收取申购费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时亚洲票息收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等债券，债券基金，银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、货币市场基金等货币市场工具以及中国证监会允许投资的其他金融工具，包括货币远期/期货/互换、利率互换、信用违约互换等风险对冲工具。本基金不主动参与股票等权益类资产的投资，包括不直接从二级市场买入股票等权益类资产和权证，不参与一级市场的新股申购或增发新股。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于亚洲市场债券的资产占债券资产的比例不低于 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时亚洲票息收益债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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。

#### 6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年

12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从境内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。

目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的境内企业债券利息收入，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。

目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.6 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.6.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
活期存款	361,771,346.29
等于：本金	361,769,122.39
加：应计利息	2,223.90
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	361,771,346.29

注：于 2025 年 06 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：欧元 3,140.02 (折合人民币 26,383.70)，

港币 10,250,000.00 (折合人民币 9,347,487.50), 美元 32,336,123.75 (折合人民币 231,481,375.48)。

#### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资 - 金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	债券境外市场	5,216,077,052.23	62,771,044.48	5,337,120,811.52	58,272,714.81
	合计	5,216,077,052.23	62,771,044.48	5,337,120,811.52	58,272,714.81
资产支持证券		379,784,845.54	1,980,132.33	383,418,121.79	428,526.94
基金		82,538,378.12	-	82,127,038.50	-411,339.62
其他		-	-	-	-
合计		5,678,400,275.89	64,751,176.81	5,802,665,971.81	58,289,902.13

#### 6.4.6.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.6.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

#### 6.4.6.4 买入返售金融资产

##### 6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.6.5 其他权益工具投资

##### 6.4.6.5.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.6.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

#### 6.4.6.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.6.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	10,732.08
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	88,268.27
合计	99,000.35

#### 6.4.6.8 实收基金

金额单位：人民币元

博时亚洲票息收益债券 A		
项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,272,501,295.79	1,272,501,295.79
本期申购	186,714,200.98	186,714,200.98
本期赎回（以“-”号填列）	-148,686,378.66	-148,686,378.66
本期末	1,310,529,118.11	1,310,529,118.11

金额单位：人民币元

博时亚洲票息收益债券C		
项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,657,322,603.84	1,657,322,603.84
本期申购	1,397,019,902.62	1,397,019,902.62
本期赎回（以“-”号填列）	-355,074,185.08	-355,074,185.08

本期末	2,699,268,321.38	2,699,268,321.38
-----	------------------	------------------

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)。

#### 6.4.6.9 未分配利润

##### 博时亚洲票息收益债券 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	388,097,418.73	185,501,006.16	573,598,424.89
本期期初	388,097,418.73	185,501,006.16	573,598,424.89
本期利润	28,245,230.86	10,021,055.22	38,266,286.08
本期基金份额交易产生的变动数	12,233,863.82	6,245,077.97	18,478,941.79
其中：基金申购款	59,320,468.20	28,068,843.52	87,389,311.72
基金赎回款	-47,086,604.38	-21,823,765.55	-68,910,369.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	428,576,513.41	201,767,139.35	630,343,652.76

##### 博时亚洲票息收益债券 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	503,281,657.60	241,562,744.59	744,844,402.19
本期期初	503,281,657.60	241,562,744.59	744,844,402.19
本期利润	43,807,676.98	18,106,011.40	61,913,688.38
本期基金份额交易产生的变动数	331,812,118.63	155,848,046.21	487,660,164.84
其中：基金申购款	443,729,355.21	207,506,450.62	651,235,805.83
基金赎回款	-111,917,236.58	-51,658,404.41	-163,575,640.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	878,901,453.21	415,516,802.20	1,294,418,255.41

#### 6.4.6.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	67,550.15
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	-
其他	34,265.99
合计	101,816.14

#### 6.4.6.11 股票投资收益

无发生额。

#### 6.4.6.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	250,101,327.55
减：卖出/赎回基金成本总额	254,343,068.18
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	-
基金投资收益	-4,241,740.63

#### 6.4.6.13 债券投资收益

##### 6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	107,907,172.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,481,230.30
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	109,388,402.77

##### 6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,179,199,212.61
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,130,920,594.57
减：应计利息总额	46,797,387.74
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	1,481,230.30

#### 6.4.6.14 资产支持证券投资收益

##### 6.4.6.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收	4,149,692.11



入	
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-1,959,251.45
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,190,440.66

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

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	132,903,204.78
减：卖出资产支持证券成本总额	134,786,234.01
减：应计利息总额	76,222.22
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-1,959,251.45

#### 6.4.6.15 衍生工具收益

##### 6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

##### 6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
外汇期货投资收益	-1,298,644.27
合计	-1,298,644.27

#### 6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	1,510,518.22
合计	1,510,518.22

#### 6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	28,127,066.62

——股票投资	—
——债券投资	27,566,403.10
——资产支持证券投资	972,003.14
——基金投资	-411,339.62
——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	28,127,066.62

#### 6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	1,195,411.98
基金转换费收入	2,565.15
其它收入	26,378.14
合计	1,224,355.27

#### 6.4.6.19 信用减值损失

无发生额。

#### 6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	28,760.90
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行汇划费用	32,962.91
合计	121,231.18

#### 6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

##### 6.4.7.2 资产负债表日后事项

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），规定自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后

（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

#### 6.4.8 关联方关系

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
布朗兄弟哈里曼银行（“BBH”）	境外资产托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 6.4.9.2 关联方报酬

###### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	19,047,617.39	11,695,894.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,696,425.39	2,288,400.43
应支付基金管理人的净管理费	15,351,192.00	9,407,493.72

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 0.80% 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 × 0.80% / 当年天数。

由于基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

###### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月
----	-------------------------	------------------------------

	30日	30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,952,380.45	3,654,966.95

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.9.2.3 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 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时亚洲票息收益债券 A	博时亚洲票息收益债券 C	合计
招商证券	-	17.32	17.32
招商银行	-	8,376.74	8,376.74
博时基金	-	66,452.35	66,452.35
博时财富	-	784.71	784.71
合计	-	75,631.12	75,631.12
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时亚洲票息收益债券 A	博时亚洲票息收益债券 C	合计
招商银行	-	5,305.21	5,305.21
博时基金	-	73,071.85	73,071.85
博时财富基金销售有限公司	-	34.00	34.00
合计	-	78,411.06	78,411.06

注：于本期及上年度可比期间，截至 2024 年 1 月 9 日止，支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 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：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

自 2024 年 1 月 10 日起，支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.01% 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：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.01% / 当年天数。

#### 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.9.4 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

##### 6.4.9.4.1 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。

#### 6.4.9.4.2 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。

#### 6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.9.5.2 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。

#### 6.4.9.6 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	25,735,404.61	67,550.15	12,213,802.23	46,033.36
布朗兄弟哈里曼银行	336,035,941.68	-	116,218,734.82	-

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。

#### 6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10 利润分配情况

无。

#### 6.4.11 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

无。

##### 6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

无。

无。

###### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.12 金融工具风险及管理

##### 6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于债券型基金，主要投资于亚洲市场的各类债券，其预期收益及风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于中等风险/中等收益特征的开放式基金。本基金为主动式投资的债券型基金，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通过分析亚洲区域各个国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面，寻找各类债券的投资机会，在谨慎投资的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

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、法律合规部、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；法律合规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。

##### 6.4.12.2 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。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内交易所进行的交易主要以中国

证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在场外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。

#### 6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.12.2.4 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 2025年6月30日	上年末 2024年12月31日
AAA	106,802,509.00	162,054,401.47
AAA 以下	4,737,767,311.85	3,525,775,652.01
未评级	492,550,990.67	433,682,562.19
合计	5,337,120,811.52	4,121,512,615.67

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

#### 6.4.12.2.5 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 2025年6月30日	上年末 2024年12月31日
AAA	—	—
AAA 以下	—	—
未评级	383,418,121.79	—
合计	383,418,121.79	—

#### 6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于开放期内要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。



针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

于本期末，除卖出回购金融资产款余额（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.12.3.1 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。

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。

#### 6.4.12.4 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。

#### 6.4.12.4.1 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。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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>					
货币资金	361,771,346.29	-	-	-	361,771,346.29
结算备付金	-	-	-	5,425,015.22	5,425,015.22
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	341,239,988.33	2,392,158,114.74	2,987,140,830.24	82,127,038.50	5,802,665,971.81
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	9,099,754.44	9,099,754.44
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>703,011,334.62</b>	<b>2,392,158,114.74</b>	<b>2,987,140,830.24</b>	<b>96,651,808.16</b>	<b>6,178,962,087.76</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	39,418,915.47	39,418,915.47
应付清算款	-	-	-	199,318,081.70	199,318,081.70
应付管理人报酬	-	-	-	3,745,442.85	3,745,442.85
应付托管	-	-	-	1,170,450.89	1,170,450.89

费					
应付销售服务费	-	-	-	30,964.98	30,964.98
应交税费	-	-	-	619,883.86	619,883.86
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	99,000.35	99,000.35
负债总计	-	-	-	244,402,740.10	244,402,740.10
利率敏感度缺口	703,011,334.62	22,392,158,114.74	2,987,140,830.24	-147,750,931.94	5,934,559,347.66
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	79,793,063.19	-	-	-	79,793,063.19
结算备付金	-	-	-	6,904,741.72	6,904,741.72
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	589,048,339.75	1,638,916,441.19	1,893,547,834.73	-	4,121,512,615.67
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	64,642,924.97	64,642,924.97
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	4,025,504.00	4,025,504.00
资产总计	668,841,402.94	1,638,916,441.19	1,893,547,834.73	75,573,170.69	4,276,878,849.55
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	24,298,505.60	24,298,505.60
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,780,890.75	2,780,890.75
应付托管费	-	-	-	869,028.39	869,028.39
应付销售服务费	-	-	-	19,190.14	19,190.14

应交税费	-	-	-	457,467.71	457,467.71
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	187,040.25	187,040.25
负债总计	-	-	-	28,612,122.84	28,612,122.84
利率敏感度缺口	668,841,402.94	1,638,916,441.19	1,893,547,834.73	46,961,047.85	4,248,266,726.71

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

#### 6.4.12.4.1.2 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 5,736	减少约 3,735
	市场利率下降 25 个基点	增加约 5,736	增加约 3,735

#### 6.4.12.4.2 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.12.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	231,481,375.48	9,347,487.50	26,383.70	240,855,246.68
结算备付金	347,852.98	-	-	347,852.98
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	5,774,678,005.93	27,987,965.88	-	5,802,665,971.81
应收股利	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收申购款	7,817.05	-	-	7,817.05
应收利息	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	6,006,515,051.44	37,335,453.38	26,383.70	6,043,876,888.52
以外币计价的负债				
应付赎回款	3,300,292.42	-	-	3,300,292.42

应付清算款	189,971,544.15	9,346,537.55	-	199,318,081.70
应付利息	-	-	-	-
其他负债	411.54	-	-	411.54
负债合计	193,272,248.11	9,346,537.55	-	202,618,785.66
资产负债表外 汇风险敞口净 额	5,813,242,803.33	27,988,915.83	26,383.70	5,841,258,102.86
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的 资产				
货币资金	51,318,806.35	2,378,122.17	1,798.94	53,698,727.46
结算备付金	656,389.48	-	-	656,389.48
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资 产	4,068,981,472.20	41,099,003.11	11,432,140.36	4,121,512,615.67
应收股利	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收申购款	5,462.61	-	-	5,462.61
应收利息	-	-	-	-
其他资产	4,025,504.00	-	-	4,025,504.00
资产合计	4,124,987,634.64	43,477,125.28	11,433,939.30	4,179,898,699.22
以外币计价的 负债				
应付赎回款	6,447,894.38	-	-	6,447,894.38
应付清算款	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
其他负债	26.09	-	-	26.09
负债合计	6,447,920.47	-	-	6,447,920.47
资产负债表外 汇风险敞口净 额	4,118,539,714.17	43,477,125.28	11,433,939.30	4,173,450,778.75

#### 6.4.12.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	所有外币均相对人民币升值 5%	增加约 29,390	增加约 20,867
	所有外币均相对人民币贬值 5%	减少约 29,390	减少约 20,867

注：以上金额为四舍五入后的结果。

#### 6.4.12.4.3 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。

##### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	—	—	—	—
交易性金融资产—基金投资	82,127,038.50	1.38	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	82,127,038.50	1.38	—	—

##### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 629	—
	业绩比较基准下降 5%	减少约 629	—

#### 6.4.13 公允价值

##### 6.4.13.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.13.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年6月30日
第一层次	82,127,038.50
第二层次	5,720,538,933.31
第三层次	—
合计	5,802,665,971.81

##### 6.4.13.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.13.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### 6.4.13.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	—	—
	其中：普通股	—	—
	存托凭证	—	—
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	—	—

2	基金投资	82,127,038.50	1.33
3	固定收益投资	5,720,538,933.31	92.58
	其中：债券	5,337,120,811.52	86.38
	资产支持证券	383,418,121.79	6.21
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	367,196,361.51	5.94
8	其他各项资产	9,099,754.44	0.15
9	合计	6,178,962,087.76	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

无。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

无。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

本基金本报告期末进行权益资产的投资。

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
--------	------	------------------

AAA+至 AAA-	106,802,509.00	1.80
AA+至 AA-	432,947,465.46	7.30
A+至 A-	1,542,883,910.92	26.00
BBB+至 BBB-	2,168,851,576.41	36.55
BB+至 BB-	593,084,359.06	9.99
未评级	492,550,990.67	8.30
合计	5,337,120,811.52	89.93

注：信用等级分类采用境外专业评级机构提供的债项评级。其中无债项评级的债券，其发行人信用评级补充如下：

未评级债券发行人信用评级	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
A+至 A-	14,190,779.12	0.24
BB+至 BB-	32,449,313.37	0.55
未评级(发行人)	445,910,898.18	7.51
合计	492,550,990.67	8.30

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	US912810UG12	T 4 5/8 02/15/55	420,000	298,439,334.92	5.03
2	XS3094282343	MTRC 5 5/8 PERP	150,000	108,235,347.53	1.82
3	US912797PN17	B 08/14/25	150,000	106,802,509.00	1.80
4	USJ54675BE26	NIPLIF 6 1/2 04/30/55	120,000	89,676,402.63	1.51
5	US47215PAJ57	JD 0 1/4 06/01/29	100,000	74,653,340.77	1.26

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	US36180AAH68	G2 MA9908	200,000.00	113,446,274.30	1.91
2	US36179Y5N09	G2 MA9853	190,000.00	99,711,326.12	1.68
3	US36179Y5M26	G2 MA9852	150,000.00	93,785,834.55	1.58
4	US36179Y2N36	G2 MA9781	150,000.00	76,474,686.82	1.29

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。



## 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	ISHARES 20+ YEAR TREASURY BD	ETF	开放式	-	82,127,038.50	1.38

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只基金。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.11.2 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,099,754.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,099,754.44

### 7.11.3 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。

### 7.11.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.11.5 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
博时亚洲票息收益债券 A	29,416	44,551.57	558,448,396.32	42.61%	752,080,721.79	57.39%
博时亚洲票息收益债券 C	60,888	44,331.70	2,345,152,791.83	86.88%	354,115,529.55	13.12%
合计	83,341	48,113.14	2,903,601,188.15	72.41%	1,106,196,251.34	27.59%

### 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	博时亚洲票息收益债券 A	2,228,079.83	0.17%
	博时亚洲票息收益债券 C	879,871.80	0.03%
	合计	3,107,951.63	0.08%

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	博时亚洲票息收益债券 A	>100
	博时亚洲票息收益债券 C	-
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	博时亚洲票息收益债券 A	-
	博时亚洲票息收益债券 C	0~10
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时亚洲票息收益债券 A	博时亚洲票息收益债券 C
基金合同生效日(2013 年 2 月 1 日) 基金份额总额	1,790,533,225.99	-
本报告期期初基金份额总额	1,272,501,295.79	1,657,322,603.84
本报告期基金总申购份额	186,714,200.98	1,397,019,902.62
减：本报告期基金总赎回份额	148,686,378.66	355,074,185.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	1,310,529,118.11	2,699,268,321.38
--------------	------------------	------------------

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期内，无涉及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 2024 年起改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 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	

CLP	-	-	-	117,396.60	100.00%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-

注：无。

### 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		基金交易	
	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 基金成 交总额 的比例
CLP	-	-	-	-	586,982,773.85	100.00%
AHCL	57,242,899.59	0.77%	-	-	-	-
ANZ	87,450,659.15	1.18%	-	-	-	-
BARC	38,193,025.92	0.51%	-	-	-	-
BMO	35,220,685.53	0.47%	-	-	-	-
BNPX	135,550,588.30	1.83%	-	-	-	-
CACIB	100,695,318.81	1.36%	-	-	-	-
CG	1,311,082,965.78	17.67%	-	-	-	-
CICF	57,619,010.48	0.78%	-	-	-	-
CITICBANK	200,165,689.02	2.70%	-	-	-	-
CSEC	111,079,565.45	1.50%	-	-	-	-
DAR5	3,594,300.00	0.05%	-	-	-	-
DBJP	284,860,867.58	3.84%	-	-	-	-
DBS	36,015,260.22	0.49%	-	-	-	-
GS	933,675,269.04	12.58%	-	-	-	-
GTHK	82,856,123.24	1.12%	-	-	-	-
HSBC	594,510,212.53	8.01%	-	-	-	-
HTIL	86,343,578.67	1.16%	-	-	-	-
HUATAI	46,348,378.02	0.62%	-	-	-	-
ICBCI	43,160,099.82	0.58%	-	-	-	-
JEF	262,209,786.27	3.53%	-	-	-	-
JEF3	43,318,489.23	0.58%	-	-	-	-
JP	949,768,648.46	12.80%	-	-	-	-
MIHO	132,746,247.60	1.79%	-	-	-	-
MIRAE	28,735,634.79	0.39%	-	-	-	-
MLAP	722,979,832.87	9.74%	-	-	-	-
MS	396,082,317.94	5.34%	-	-	-	-
NOMURA	95,799,944.93	1.29%	-	-	-	-
SCD1	347,730,002.33	4.69%	-	-	-	-

UBSBOND	71,409,558.63	0.96%	-	-	-	-
UBSL	123,236,090.57	1.66%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序：

(1) 本公司根据法规要求制定《博时基金公募基金证券交易佣金分配管理办法》，明确选择证券公司参与证券交易的标准和程序，并建立证券公司的准入管理机制，符合筛选标准的证券公司可纳入公司证券公司白名单库，并持续动态管理。

(2) 本公司选择证券公司参与证券交易的主要标准是财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。严禁基金销售业务人员参与证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

(3) 本公司建立公正公平的证券公司服务评价体系，在符合上述标准的证券公司中进行基金的证券交易佣金分配。主要程序：双方签署服务协议；证券公司提供交易和研究服务；公司每季度分别按照被动股票型基金和其他类型基金的服务评价规则，对证券公司进行服务评价，并按照评分排名确定佣金的分配资格和比例额度。

## 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	博时亚洲票息收益债券型证券投资基金（博时亚洲票息收益债券 A 人民币）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-26
2	博时亚洲票息收益债券型证券投资基金（博时亚洲票息收益债券 C 美元现汇）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-26
3	博时亚洲票息收益债券型证券投资基金（博时亚洲票息收益债券 A 美元钞）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-26
4	博时亚洲票息收益债券型证券投资基金（博时亚洲票息收益债券 A 美元现汇）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-26
5	博时亚洲票息收益债券型证券投资基金（博时亚洲票息收益债券 C 人民币）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-26
6	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-20250606	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-06
7	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-20250603	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-03
8	博时亚洲票息收益债券型证券投资基金 2025 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站	2025-04-22
9	博时基金管理有限公司关于运用公司固有资金	中国证券报、基金管理人	2025-04-08

	投资旗下公募基金的公告	网站、证监会基金电子披露网站	
10	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-20250408	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
11	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
12	博时亚洲票息收益债券型证券投资基金 2024 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站	2025-03-31
13	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-20250325	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-25
14	博时亚洲票息收益债券型证券投资基金 2024 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站	2025-01-22
15	博时亚洲票息收益债券型证券投资基金 2025 年境外主要市场节假日暂停申购、赎回等交易类业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-08

## § 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

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时亚洲票息收益债券型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时亚洲票息收益债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时亚洲票息收益债券型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时亚洲票息收益债券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  
二〇二五年八月二十九日