

# 博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金

## 2026 年第 2 季度报告

### 2026 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：二〇二六年七月二十一日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                         |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 博时中债 1-3 年国开行                                                                                                                                                                                           |
| 基金主代码      | 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                                                                                                                                                                                         |
| 报告期末基金份额总额 | 1,967,223,718.24 份                                                                                                                                                                                      |
| 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</p> |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                 |
|-----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|
|                 | <p>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，本基金可采取适当方法，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进行跟踪复制。</p> <p>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。</p> |                 |
| 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。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                 |
| 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                 |
| 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 | 1,920,456,779.10 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 46,766,939.14 份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期                              |                 |
|----------------|----------------------------------|-----------------|
|                | (2026 年 4 月 1 日-2026 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 |
| 1.本期已实现收益      | 11,371,959.69                    | 327,374.88      |
| 2.本期利润         | 10,572,762.36                    | 301,599.63      |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0078                           | 0.0075          |
| 4.期末基金资产净值     | 1,974,086,243.18                 | 48,005,680.69   |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0279                           | 1.0265          |

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

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

### 3.2 基金净值表现

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

##### 1. 博时中债1-3年国开行A:

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①－③    | ②－④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 0.81%      | 0.04%         | 0.56%          | 0.01%                 | 0.25%  | 0.03% |
| 过去六个月          | 1.41%      | 0.03%         | 1.15%          | 0.01%                 | 0.26%  | 0.02% |
| 过去一年           | 1.56%      | 0.03%         | 1.86%          | 0.02%                 | -0.30% | 0.01% |
| 过去三年           | 7.76%      | 0.04%         | 7.12%          | 0.03%                 | 0.64%  | 0.01% |
| 过去五年           | 14.73%     | 0.04%         | 13.67%         | 0.03%                 | 1.06%  | 0.01% |
| 过去七年           | 21.23%     | 0.05%         | 21.07%         | 0.04%                 | 0.16%  | 0.01% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 22.15%     | 0.05%         | 21.95%         | 0.04%                 | 0.20%  | 0.01% |

##### 2. 博时中债1-3年国开行C:

| 阶段 | 净值增长率<br>① | 净值增长率 | 业绩比较基 | 业绩比较基 | ①－③ | ②－④ |
|----|------------|-------|-------|-------|-----|-----|
|----|------------|-------|-------|-------|-----|-----|

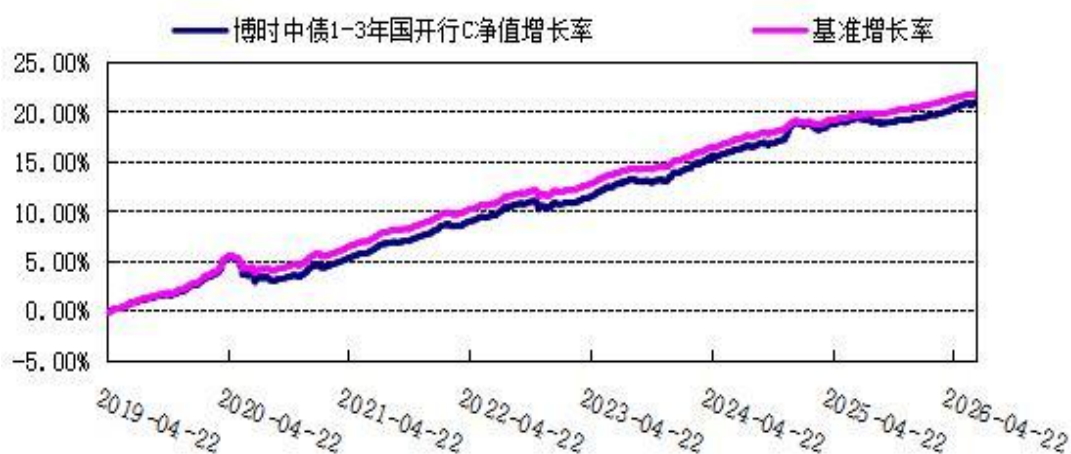
|            |        | 标准差②  | 准收益率③  | 准收益率标准差④ |        |       |
|------------|--------|-------|--------|----------|--------|-------|
| 过去三个月      | 0.79%  | 0.04% | 0.56%  | 0.01%    | 0.23%  | 0.03% |
| 过去六个月      | 1.35%  | 0.03% | 1.15%  | 0.01%    | 0.20%  | 0.02% |
| 过去一年       | 1.45%  | 0.03% | 1.86%  | 0.02%    | -0.41% | 0.01% |
| 过去三年       | 7.42%  | 0.04% | 7.12%  | 0.03%    | 0.30%  | 0.01% |
| 过去五年       | 14.06% | 0.04% | 13.67% | 0.03%    | 0.39%  | 0.01% |
| 过去七年       | 20.17% | 0.05% | 21.07% | 0.04%    | -0.90% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 21.06% | 0.05% | 21.95% | 0.04%    | -0.89% | 0.01% |

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

#### 1. 博时中债1-3年国开行A:



#### 2. 博时中债1-3年国开行C:



## §4 管理人报告

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                                  | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|-----|-------------------------------------|-------------|------|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                     | 任职日期        | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 张朱霖 | 基金经理                                | 2025-07-29  | -    | 9.9    | 张朱霖先生，硕士。2016 年至 2019 年在鹏华基金工作，2019 年加入博时基金管理有限公司。历任高级研究员、资深研究员、基金经理助理兼资深研究员、博时景发纯债债券型证券投资基金(2025 年 8 月 5 日-2026 年 1 月 22 日)基金经理。现任博时裕发纯债债券型证券投资基金(2025 年 2 月 26 日—至今)、博时广利纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2025 年 3 月 10 日—至今)、博时上证 30 年期国债交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 3 月 27 日—至今)、博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金(2025 年 7 月 29 日—至今)的基金经理，博时安弘一年定期开放债券型发起式证券投资基金、博时合惠货币市场基金、博时双月乐 60 天持有期债券型证券投资基金、博时锦源利率债债券型证券投资基金、博时岁岁增利一年持有期债券型证券投资基金的基金经理助理。                                                    |
| 魏桢  | 董事总经理/固定收益投资二部总经理/固定收益投资二部投资总监/基金经理 | 2025-07-29  | -    | 17.9   | 魏桢女士，硕士。2004 年起在厦门市商业银行任债券交易组主管。2008 年加入博时基金管理有限公司。历任债券交易员、固定收益研究员、博时理财 30 天债券型证券投资基金(2013 年 1 月 28 日-2015 年 9 月 11 日)、博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金(2013 年 6 月 26 日-2016 年 4 月 25 日)、博时月月薪定期支付债券型证券投资基金(2013 年 7 月 25 日-2016 年 4 月 25 日)、博时双月薪定期支付债券型证券投资基金(2013 年 10 月 22 日-2016 年 4 月 25 日)、博时天天增利货币市场基金(2014 年 8 月 25 日-2017 年 4 月 26 日)、博时保证金实时交易型货币市场基金(2015 年 6 月 8 日-2017 年 4 月 26 日)、博时安盈债券型证券投资基金(2015 年 5 月 22 日-2017 年 5 月 31 日)、博时产业债纯债债券型证券投资基金(2016 年 5 月 25 日-2017 年 5 月 |

|  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  | 31 日)、博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2015 年 11 月 24 日-2017 年 6 月 15 日)、博时聚享纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 19 日-2017 年 10 月 27 日)、博时安仁一年定期开放债券型证券投资基金(2016 年 6 月 24 日-2017 年 11 月 8 日)、博时裕鹏纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 22 日-2017 年 12 月 29 日)、博时安润 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2016 年 5 月 20 日-2018 年 1 月 12 日)、博时安恒 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2016 年 9 月 22 日-2018 年 4 月 2 日)、博时安丰 18 个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)(2013 年 8 月 22 日-2018 年 6 月 21 日)的基金经理、固定收益总部现金管理组投资副总监、博时现金宝货币市场基金(2014 年 9 月 18 日-2019 年 2 月 25 日)、博时外服货币市场基金(2015 年 6 月 19 日-2019 年 2 月 25 日)、博时合利货币市场基金(2016 年 8 月 3 日-2019 年 2 月 25 日)、博时合鑫货币市场基金(2016 年 10 月 12 日-2019 年 2 月 25 日)、博时合晶货币市场基金(2017 年 8 月 2 日-2019 年 2 月 25 日)、博时兴盛货币市场基金(2017 年 12 月 29 日-2019 年 2 月 25 日)、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金(2014 年 9 月 22 日-2019 年 3 月 4 日)、博时裕创纯债债券型证券投资基金(2016 年 5 月 13 日-2019 年 3 月 4 日)、博时裕盛纯债债券型证券投资基金(2016 年 5 月 20 日-2019 年 3 月 4 日)、博时丰庆纯债债券型证券投资基金(2017 年 8 月 23 日-2019 年 3 月 4 日)、博时安弘一年定期开放债券型证券投资基金(2016 年 11 月 15 日-2019 年 11 月 12 日)的基金经理、固定收益总部现金管理组负责人、博时裕安纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2020 年 5 月 8 日-2021 年 10 月 27 日)、博时安仁一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2020 年 9 月 9 日-2021 年 10 月 27 日)、博时月月享 30 天持有期短债债券型发起式证券投资基金(2021 年 5 月 12 日-2024 |
|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|



|  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  | 年 6 月 7 日)、博时月月乐同业存单 30 天持有期混合型证券投资基金(2022 年 6 月 7 日-2024 年 6 月 7 日)、博时保证金实时交易型货币市场基金(2024 年 3 月 12 日-2025 年 12 月 29 日)、博时富耀纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2023 年 6 月 21 日-2026 年 5 月 7 日)的基金经理。现任董事总经理兼固定收益投资二部总经理、固定收益投资二部投资总监、博时现金收益证券投资基金(2015 年 5 月 22 日—至今)、博时合惠货币市场基金(2017 年 5 月 31 日—至今)、博时安弘一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2019 年 11 月 12 日—至今)、博时锦源利率债债券型证券投资基金(2023 年 12 月 13 日—至今)、博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 3 月 12 日—至今)、博时中债 5-10 年农发行债券指数证券投资基金(2024 年 3 月 12 日—至今)、博时中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金(2024 年 3 月 12 日—至今)、博时富华纯债债券型证券投资基金(2024 年 8 月 27 日—至今)、博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金(2025 年 7 月 29 日—至今)的基金经理。 |
|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。



### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 10 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年二季度，经济 K 型分化加剧，出口及 AI 产业链表现强劲，传统经济弱修复。地缘冲突导致原油价格大幅波动，各国输入性通胀压力有所提高。国内货币政策保持定力，流动性整体充裕，资金面均衡宽松。

2026 年二季度债券收益率震荡下行。具体来看：4 月资金面超预期宽松，收益率快速下行，短端和中长端同步走强。下旬超长期特别国债发行安排落地，普通国债二季度发行提速，叠加 4 月 PMI 维持在 50.3% 扩张区间，长债和超长债出现阶段性止盈。5 月初债市震荡为主，中旬公布经济数据不及预期，流动性延续宽松格局，长端再探阶段低位，月末 10 年、30 年国债收益率下行至 1.70%、2.20% 附近。6 月上中旬，受季末因素扰动，资金边际收敛甚至一度偏紧，债市出现回调；6 月下旬在央行加量续作 MLF 以及隔夜逆回购工具对冲下，债市流动性预期改善，10 年、30 年国债收益率再次下行至 1.71%、2.21% 附近。

组合操作上，本组合为指数基金，在跟踪指数走势的同时，组合采取积极灵活的操作策略。报告期内，组合维持了中性偏长久期，同时重点布局部分性价比较高券种，对组合收益形成了支撑。

展望后市，预计经济 K 型分化仍将延续，资金利率围绕利率走廊窄幅波动。内需偏弱、政策持稳、资金面均衡的宏观环境下，债市有望维持区间震荡。收益率下行突破关键点位仍有赖于资金利率的进一步下行，后续密切关注货币政策变动。策略上，组合根据市场变化灵活应对。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0279 元，份额累计净值为 1.2040 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0265 元，份额累计净值为 1.1947 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为

0.81%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 0.79%，同期业绩基准增长率为 0.56%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -            |
|    | 其中：股票             | -                | -            |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 2,189,245,001.36 | 92.80        |
|    | 其中：债券             | 2,189,245,001.36 | 92.80        |
|    | 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          | 41,001,741.10    | 1.74         |
|    | 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      | 15,224,977.59    | 0.65         |
| 8  | 其他各项资产            | 113,506,214.90   | 4.81         |
| 9  | 合计                | 2,358,977,934.95 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

#### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 2,189,245,001.36 | 108.27       |
|    | 其中：政策性金融债 | 2,189,245,001.36 | 108.27       |
| 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        | 2,189,245,001.36 | 108.27       |

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码     | 债券名称       | 数量（张）     | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 09250202 | 25 国开清发 02 | 4,350,000 | 437,922,127.40 | 21.66        |
| 2  | 190210   | 19 国开 10   | 3,800,000 | 405,270,000.00 | 20.04        |
| 3  | 190205   | 19 国开 05   | 3,200,000 | 341,436,668.49 | 16.89        |
| 4  | 240203   | 24 国开 03   | 2,700,000 | 278,377,767.12 | 13.77        |
| 5  | 230203   | 23 国开 03   | 2,400,000 | 247,989,567.12 | 12.26        |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制前一年受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局、河南金融监管局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)          |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | -              |
| 2  | 应收证券清算款 | 112,134,337.26 |
| 3  | 应收股利    | -              |

|   |       |                |
|---|-------|----------------|
| 4 | 应收利息  | -              |
| 5 | 应收申购款 | 1,371,877.64   |
| 6 | 其他应收款 | -              |
| 7 | 其他    | -              |
| 8 | 合计    | 113,506,214.90 |

### 5.11.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.4 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.11.5 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。

## §6 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  |
|----------------|------------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 1,310,457,063.93 | 31,801,469.60 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 814,843,659.89   | 32,432,747.71 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 204,843,944.72   | 17,467,278.17 |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -                | -             |
| 本报告期期末基金份额总额   | 1,920,456,779.10 | 46,766,939.14 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目             | 博时中债1-3年国开行A | 博时中债1-3年国开行C |
|----------------|--------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金 | 4.01         | -            |

|                          |      |   |
|--------------------------|------|---|
| 份额                       |      |   |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -    | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -    | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 4.01 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.00 | - |

注：1.申购含红利再投、转换入、级别调整入份额，赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

2.基金管理人博时基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期       | 交易份额（份） | 交易金额（元） | 适用费率 |
|----|------|------------|---------|---------|------|
| 1  | 现金分红 | 2026-04-14 | -       | -0.01   | -    |
| 合计 |      |            | -       | -0.01   |      |

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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              | 2026-05-29~2026-06-30   | -              | 486,948,772.89 | -    | 486,948,772.89 | 24.75% |
|       | 2              | 2026-04-01~2026-05-28   | 284,683,905.86 | -              | -    | 284,683,905.86 | 14.47% |

#### 产品特有风险

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

在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

注：1.申购份额包含红利再投资份额。

2.份额占比为四舍五入后的结果。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2026 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 404 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 17,353 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 6,993 亿元人民币，累计分红逾 2,312 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。

## §9 备查文件目录

---

### 9.1 备查文件目录

- 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
- 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》
- 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》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 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
- 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

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 9.3 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

二〇二六年七月二十一日