

博时智臻纯债债券型证券投资基金 2016年年度报告摘要

2016年12月31日

基金管理人:博时基金管理有限公司 基金托管人:中国建设银行股份有限公司 报告送出日期:二〇一七年三月二十七日

7 年度财务报表

意见的审计报告,投资者欲了解审计报告详细内容,可通过登录博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

7.1 资产负债表

会计主体:博时智臻纯债债券型证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资产	本报告期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
货币资金	13,689,611.53	40,503.56
结算备付金	—	—
应收利息	—	—
应收股利	—	—
买入返售金融资产	—	—
其他金融资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	13,689,611.53	40,503.56
负债	—	—
短期借款	—	—
应付票据	—	—
应付账款	—	—
应付利息	—	—
应付股利	—	—
其他金融负债	—	—
其他负债	—	—
负债总计	—	—
所有者权益	13,689,611.53	40,503.56
实收基金	970,840,200.00	970,840,200.00
未分配利润	2,818,411.53	2,818,411.53
所有者权益合计	973,658,611.53	973,658,611.53

注:本基金本报告期末无股指期货合约持仓、国债期货合约持仓。

7.2 利润表

会计主体:博时智臻纯债债券型证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

项目	本报告 2016年12月31日	上年度 2015年12月31日
一、营业收入	66,072.28	43,824.97
利息收入	9,202,265.09	8,948,200.71
其中:存款利息收入	43,824.97	—
债券利息收入	9,158,440.12	8,948,200.71
其他利息收入	200,879.90	—
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-897,751.81	—
其他业务收入	—	—
投资收益	970,525,954.49	1,865,011.42
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	897,751.81	—
其他综合收益	—	—
营业利润	1,000,132,989.87	1,865,011.42
营业外收入	—	—
营业外支出	—	—
利润总额	1,000,132,989.87	1,865,011.42
所得税费用	—	—
净利润	1,000,132,989.87	1,865,011.42
归属于基金持有人的净利润	1,000,132,989.87	1,865,011.42
其他综合收益	—	—
综合收益总额	1,000,132,989.87	1,865,011.42
归属于基金持有人的综合收益总额	1,000,132,989.87	1,865,011.42
未分配利润	2,818,411.53	2,818,411.53
归属于基金持有人的未分配利润	2,818,411.53	2,818,411.53

注:本基金本报告期末无股指期货合约持仓、国债期货合约持仓。

7.3 所有者权益(或基金净值)变动表

会计主体:博时智臻纯债债券型证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

项目	本报告 2016年12月31日	上年度 2015年12月31日
一、基金份额总额	66,072.28	43,824.97
1.期初余额	9,202,265.09	8,948,200.71
2.本期增加	43,824.97	—
3.本期减少	8,948,200.71	—
4.期末余额	200,879.90	—
二、未分配利润	-897,751.81	—
1.期初余额	—	—
2.本期增加	1,865,011.42	—
3.本期减少	—	—
4.期末余额	1,865,011.42	—
三、所有者权益合计	1,000,132,989.87	1,865,011.42

注:本基金本报告期末无股指期货合约持仓、国债期货合约持仓。

7.4 关联方关系

关联方名称

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司(“博时基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人股东
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金管理人股东
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金管理人股东
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	基金管理人股东
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金管理人股东
博时基金(中国)有限公司	基金管理人子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内控一般商业条款订立。

7.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.2 关联方报酬

7.4.2.1 基金管理人的管理费

7.4.2.2 基金托管人的托管费

7.4.2.3 销售服务费

7.4.2.4 其他费用

7.4.2.5 其他费用

7.4.2.6 其他费用

7.4.2.7 其他费用

7.4.2.8 其他费用

7.4.2.9 其他费用

7.4.2.10 其他费用

7.4.2.11 其他费用

7.4.2.12 其他费用

7.4.2.13 其他费用

7.4.2.14 其他费用

7.4.2.15 其他费用

7.4.2.16 其他费用

7.4.2.17 其他费用

7.4.2.18 其他费用

7.4.2.19 其他费用

7.4.2.20 其他费用

7.4.2.21 其他费用

7.4.2.22 其他费用

7.4.2.23 其他费用

7.4.2.24 其他费用

7.4.2.25 其他费用

7.4.2.26 其他费用

7.4.2.27 其他费用

7.4.2.28 其他费用

7.4.2.29 其他费用

7.4.2.30 其他费用

7.4.2.31 其他费用

7.4.2.32 其他费用

7.4.2.33 其他费用

7.4.2.34 其他费用

7.4.2.35 其他费用

7.4.2.36 其他费用

7.4.2.37 其他费用

7.4.2.38 其他费用

7.4.2.39 其他费用

7.4.2.40 其他费用

7.4.2.41 其他费用

7.4.2.42 其他费用

7.4.2.43 其他费用

7.4.2.44 其他费用

7.4.2.45 其他费用

7.4.2.46 其他费用

7.4.2.47 其他费用

7.4.2.48 其他费用

7.4.2.49 其他费用

7.4.2.50 其他费用

7.4.2.51 其他费用

7.4.2.52 其他费用

7.4.2.53 其他费用

7.4.2.54 其他费用

7.4.2.55 其他费用

7.4.2.56 其他费用

7.4.2.57 其他费用

7.4.2.58 其他费用

7.4.2.59 其他费用

7.4.2.60 其他费用

7.4.2.61 其他费用

7.4.2.62 其他费用

7.4.2.63 其他费用

7.4.2.64 其他费用

7.4.2.65 其他费用

7.4.2.66 其他费用

7.4.2.67 其他费用

7.4.2.68 其他费用

7.4.2.69 其他费用

7.4.2.70 其他费用

7.4.2.71 其他费用

7.4.2.72 其他费用

7.4.2.73 其他费用

7.4.2.74 其他费用

7.4.2.75 其他费用

7.4.2.76 其他费用

7.4.2.77 其他费用

7.4.2.78 其他费用

7.4.2.79 其他费用

7.4.2.80 其他费用

7.4.2.81 其他费用

7.4.2.82 其他费用

7.4.2.83 其他费用

7.4.2.84 其他费用

7.4.2.85 其他费用

7.4.2.86 其他费用

7.4.2.87 其他费用

7.4.2.88 其他费用

7.4.2.89 其他费用

7.4.2.90 其他费用

7.4.2.91 其他费用

7.4.2.92 其他费用

7.4.2.93 其他费用

7.4.2.94 其他费用

7.4.2.95 其他费用

7.4.2.96 其他费用

7.4.2.97 其他费用

7.4.2.98 其他费用

7.4.2.99 其他费用

7.4.2.100 其他费用

7.4.2.101 其他费用

7.4.2.102 其他费用

7.4.2.103 其他费用

7.4.2.104 其他费用

7.4.2.105 其他费用

7.4.2.106 其他费用

7.4.2.107 其他费用

7.4.2.108 其他费用

7.4.2.109 其他费用

7.4.2.110 其他费用

7.4.2.111 其他费用

7.4.2.112 其他费用

7.4.2.113 其他费用

7.4.2.114 其他费用

7.4.2.115 其他费用

7.4.2.116 其他费用

7.4.2.117 其他费用

7.4.2.118 其他费用

7.4.2.119 其他费用

7.4.2.120 其他费用

7.4.2.121 其他费用

7.4.2.122 其他费用

7.4.2.123 其他费用

7.4.2.124 其他费用

7.4.2.125 其他费用

7.4.2.126 其他费用

7.4.2.127 其他费用

7.4.2.128 其他费用

7.4.2.129 其他费用

7.4.2.130 其他费用

7.4.2.131 其他费用

7.4.2.132 其他费用

7.4.2.133 其他费用

7.4.2.134 其他费用

7.4.2.135 其他费用

7.4.2.136 其他费用

7.4.2.137 其他费用

7.4.2.138 其他费用

7.4.2.139 其他费用

7.4.2.140 其他费用

7.4.2.141 其他费用

7.4.2.142 其他费用

7.4.2.143 其他费用

7.4.2.144 其他费用

7.4.2.145 其他费用

7.4.2.146 其他费用

7.4.2.147 其他费用

7.4.2.148 其他费用

7.4.2.149 其他费用

7.4.2.150 其他费用

7.4.2.151 其他费用

7.4.2.152 其他费用

7.4.2.153 其他费用

7.4.2.154 其他费用

7.4.2.155 其他费用

7.4.2.156 其他费用

7.4.2.157 其他费用

7.4.2.158 其他费用

7.4.2.159 其他费用

7.4.2.160 其他费用

7.4.2.161 其他费用

7.4.2.162 其他费用

7.4.2.163 其他费用

7.4.2.164 其他费用

7.4.2.165 其他费用

7.4.2.166 其他费用

7.4.2.167 其他费用

7.4.2.168 其他费用

7.4.2.169 其他费用

7.4.2.170 其他费用

7.4.2.171 其他费用

7.4.2.172 其他费用

7.4.2.173 其他费用

7.4.2.174 其他费用

7.4.2.175 其他费用

7.4.2.176 其他费用

7.4.2.177 其他费用

7.4.2.178 其他费用

7.4.2.179 其他费用

7.4.2.180 其他费用

7.4.2.181 其他费用

7.4.2.182 其他费用

7.4.2.183 其他费用

7.4.2.184 其他费用

7.4.2.185 其他费用

7.4.2.186 其他费用

7.4.2.187 其他费用

7.4.2.188 其他费用

7.4.2.189 其他费用

7.4.2.190 其他费用

7.4.2.191 其他费用

7.4.2.192 其他费用

7.4.2.193 其他费用

7.4.2.194 其他费用

7.4.2.195 其他费用

7.4.2.196 其他费用

7.4.2.197 其他费用