

# 博时弘泰定期开放混合型证券投资基金

## 清算报告

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

报告出具日期：二〇二三年四月十三日

报告公告日期：二〇二三年四月十九日

## 目录

|                                     |   |
|-------------------------------------|---|
| 1、重要提示.....                         | 1 |
| 1.1 重要提示.....                       | 1 |
| 2、基金概况.....                         | 1 |
| 2.1 基金基本情况.....                     | 1 |
| 2.2 基金产品说明.....                     | 2 |
| 3、基金运作情况说明.....                     | 2 |
| 4、财务报告.....                         | 3 |
| 4.1 资产负债表(已经审计).....                | 3 |
| 4.2 清算损益表.....                      | 3 |
| 4.3 报表附注.....                       | 4 |
| 5、清算情况.....                         | 7 |
| 5.1 资产负债清算情况.....                   | 7 |
| 5.2 截至本次清算期结束日的剩余财产情况及剩余财产分配安排..... | 8 |
| 6、备查文件目录.....                       | 9 |
| 6.1 备查文件目录.....                     | 9 |
| 6.2 存放地点.....                       | 9 |
| 6.3 查阅方式.....                       | 9 |

## 1、重要提示

### 1.1 重要提示

博时弘泰定期开放混合型证券投资基金(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[2016]2203号《关于准予博时弘泰定期开放混合型证券投资基金注册的批复》注册,于2016年12月9日成立并正式运作。

根据《博时弘泰定期开放混合型证券投资基金基金合同》、本基金基金份额持有人大会于2023年3月3日表决通过的《关于终止博时弘泰定期开放混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》以及博时基金管理有限公司于2023年3月4日发布的《博时基金管理有限公司关于博时弘泰定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,本基金的最后运作日定为2023年3月9日,并于2023年3月10日进入财产清算期。

2023年4月11日为本基金清算的最后一日,由本基金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、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 2、基金概况

### 2.1 基金基本情况

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 基金名称       | 博时弘泰定期开放混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 博时弘泰定开混合          |
| 基金主代码      | 160524            |
| 基金运作方式     | 契约型开放式            |
| 基金合同生效日    | 2016年12月09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 | 11,497,839.26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，追求基金资产的保值和增值。   |
| 投资策略   | 本基金分为封闭期投资策略和开放期投资策略，封闭期投资策略又分为债券投资策略、资产支持证券投资策略、中小企业私募债券投资策略、杠杆投资策略、非公开发行股票投资策略、事件驱动策略、权证投资策略、存托凭证投资策略，主要投资策略是买入与封闭期相匹配的债券，并持有到期，或者是持有回售期与封闭期相匹配的债券，获得本金和票息收入；同时，根据所持债券信用状况变化，进行必要的动态调整；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。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 | 沪深 300 指数收益率×25%+中债综合财富（总值）指数收益率×75%。   |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金品种。  |

## 3、基金运作情况说明

博时弘泰定期开放混合型证券投资基金(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[2016]2203 号《关于准予博时弘泰定期开放混合型证券投资基金注册的批复》注册，由博时基金管理有限公司于 2016 年 11 月 14 日至 2016 年 12 月 2 日向社会公开发行募集，基金合同于 2016 年 12 月 9 日正式生效，募集规模为 1,091,611,563.03 份基金份额（含利息结转的份额）。

自 2016 年 12 月 9 日至 2023 年 3 月 9 日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据《博时弘泰定期开放混合型证券投资基金基金合同》、本基金基金份额持有人大会于 2023 年 3 月 3 日表决通过的《关于终止博时弘泰定期开放混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》以及博时基金管理有限公司于 2023 年 3 月 4 日发布的《博时基金管理有限公司关于博时弘泰定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金的最后运作日定为 2023 年 3 月 9 日，并于 2023 年 3 月 10 日进入财产清算期。

## 4、财务报告

### 4.1 资产负债表(已经审计)

单位：人民币元

| 资产                | 2023年3月9日<br>(基金最后运作日) |
|-------------------|------------------------|
| <b>资产：</b>        |                        |
| 银行存款              | 23,442,423.90          |
| 结算备付金             | 356,740.22             |
| 存出保证金             | 5,237.95               |
| <b>资产总计</b>       | <b>23,804,402.07</b>   |
| <b>负债：</b>        |                        |
| 应付赎回款             | 3,933,397.55           |
| 应付管理人报酬           | 17,167.10              |
| 应付托管费             | 2,861.18               |
| 其他负债              | 124,963.62             |
| <b>负债合计</b>       | <b>4,078,389.45</b>    |
| <b>所有者权益：</b>     |                        |
| 实收基金              | 12,218,972.14          |
| 未分配利润             | 7,507,040.48           |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>19,726,012.62</b>   |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>23,804,402.07</b>   |

注：报告截止日 2023 年 3 月 9 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.6144 元，基金份额总额 12,218,972.14 份。2023 年 3 月 9 日，基金发生赎回共计 721,132.88 份于 2023 年 3 月 10 日确认。

### 4.2 清算损益表

| 项目                  | 2023年3月10日至2023年4月11日<br>(清算期间) |
|---------------------|---------------------------------|
| <b>一、清算收益</b>       | <b>7,227.86</b>                 |
| 1. 利息收入             | 7,226.25                        |
| 2. 其他收入             | 1.61                            |
| <b>二、清算费用</b>       | <b>141.94</b>                   |
| 1. 汇划费              | 141.94                          |
| <b>三、清算收益(损失)总额</b> | <b>7,085.92</b>                 |
| 减：所得税费用             | -                               |
| <b>四、清算净收益(损失)</b>  | <b>7,085.92</b>                 |

注：1. 利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2023 年 3 月 10 日至 2023 年 4 月 11 日止清算期间的活期存款利息、最低备付金利息、存出保证金利息及清算期间收到的申购款利息；

2. 其他收入为基金赎回费收入。

#### 4.3 报表附注

##### 4.3.1 基金基本情况

博时弘泰定期开放混合型证券投资基金(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[2016]2203号《关于准予博时弘泰定期开放混合型证券投资基金注册的批复》注册,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《博时弘泰定期开放混合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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,090,988,131.33 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1586 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博时弘泰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,091,611,563.03 份基金份额,其中认购资金利息折合 623,431.70 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。

根据《博时弘泰定期开放混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金以定期开放的方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自基金合同生效日起(包括基金合同生效日)或者每一个开放期结束之日次日起(包括该次日)18 个月的期间内,本基金采取封闭运作模式,基金份额持有人不得申请申购、赎回本基金。每一个封闭期结束后,本基金即进入开放期,开放期的期限为自封闭期结束之日后第一个工作日起(含该日)五至二十个工作日。开放期内,本基金采取开放运作模式,投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。开放期末赎回的份额将自动转入下一个封闭期。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时弘泰定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、次级债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。在封闭期,本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 60%,但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期前二个月、开放期及开放期结束后二个月的期间内,基金投资不受上述比例限制。本基金投资于股票(含存托凭证)资产比例为基金资

产的 0%-30%。开放期内，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×25%+中债综合财富（总值）指数收益率×75%。

根据基金管理人博时基金管理有限公司于 2023 年 3 月 3 日表决通过的《关于终止博时弘泰定期开放混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》以及博时基金管理有限公司于 2023 年 3 月 4 日发布的《博时基金管理有限公司关于博时弘泰定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金的最后运作日定为 2023 年 3 月 9 日，并于 2023 年 3 月 10 日进入财产清算期。

#### **4.3.2 清算原因**

根据《博时弘泰定期开放混合型证券投资基金基金合同》、本基金基金份额持有人大会于 2023 年 3 月 3 日表决通过的《关于终止博时弘泰定期开放混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》以及博时基金管理有限公司于 2023 年 3 月 4 日发布的《博时基金管理有限公司关于博时弘泰定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金的最后运作日定为 2023 年 3 月 9 日，并于 2023 年 3 月 10 日进入财产清算期。

#### **4.3.3 清算起始日**

据基金管理人博时基金管理有限公司于 2023 年 3 月 4 日发布的《博时基金管理有限公司关于博时弘泰定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金的清算起始日为 2023 年 3 月 10 日。

#### **4.3.4 清算财务报表的编制基础**

如财务报表附注 4.3.3 所述，自 2023 年 3 月 10 日起，本基金进入清算程序，因此本财务报表以清算基础编制。

本基金财务报表按附注 4.3.5 中所述的重要会计政策和会计估计以清算基础编制。于 2023 年 3 月 9 日（基金最后运作日），所有资产以可收回金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。

此外，本基金财务报表按照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》、《博时弘泰定期开放混合型证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及在财务报表附注 4.3.5 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。

#### 4.3.5 重要会计政策和会计估计

##### 4.3.5.1 清算期间

本清算期间为 2023 年 3 月 10 日至 2023 年 4 月 11 日。

##### 4.3.5.2 记账本位币

本清算财务报表以人民币为记账本位。

##### 4.3.5.3 应收款项的确认和计量

应收款项按照未来应收取的款项金额计量。

##### 4.3.5.4 应付款项的确认和计量

应付款项按照未来应支付的款项金额计量。

##### 4.3.5.5 清算收益的确认和计量

清算收益按照实际发生的收益金额或未来应收取的款项金额计量。

##### 4.3.5.6 清算费用的确认和计量

清算费用按照实际发生的费用金额或未来应支付的款项金额计量。

#### 4.3.6 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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 5、清算情况

### 5.1 资产负债清算情况

自 2023 年 3 月 10 日至 2023 年 4 月 11 日止为本次清算期间，基金财产清算小组对本基金的基金财产进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

截至本次清算期结束日（2023 年 4 月 11 日），各项资产负债清算情况如下：

1、本基金最后运作日上交所最低结算备付金为 356,125.00 元，该款项已于 2023 年 4 月 11 日调整为 278,565.22 元，尚未收回。本基金最后运作日上交所最低结算备付金应计利息为 608.62 元，于 2023 年 3 月 21 日结息收回 784.79 元，截至清算期结束日 2023 年 4 月 11 日账面应计利息为 349.17 元。

2、本基金最后运作日深交所最低结算备付金应计利息为 6.60 元，该款项已于 2023 年 3 月 21 日结息收回。

3、本基金最后运作日上交所结算保证金为 2,589.39 元，该款项已于 2023 年 4 月 4 日收回。本基金最后运作日上交所结算保证金应计利息为 7.34 元，于 2023 年 3 月 21 日结息收回 8.55 元，截至清算期结束日 2023 年 4 月 11 日账面应计利息为 1.68 元。

4、本基金最后运作日深交所结算保证金为 2,629.18 元，该款项已于 2023 年 4 月 4 日收回。本基金最后运作日深交所结算保证金应计利息为 12.04 元，于 2023 年 3 月 21 日结息收回 13.42 元，截至清算期结束日 2023 年 4 月 11 日账面应计利息为 1.68 元。

5、本基金最后运作日应付赎回款为人民币 3,933,397.55 元，该款项已于 2023 年 3 月 10 日和 2023 年 3 月 13 日支付。

6、本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 17,167.10 元，该款项已于 2023 年 4 月 7 日支付。

7、本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,861.18 元，该款项已于 2023 年 4 月 7 日支付。

8、本基金最后运作日其他负债为人民币 124,963.62 元，包括预提律师费、预提审计费、预提公证费、预提汇划费、应付信息披露费、应付交易费用、中债登账户维护费、上清所账户维护费等。其中预提律师费人民币 35,000.00 元，该款项将于取得律师费发票后支付；预提公证费 10,000.00 元，该款项将于取得公证费发票后支付；预提审计费人民币 47,000.00 元，该款项将于取得审计费发票后支付；预提汇划费人民币 230.00 元，该款项已于 2023 年 4 月 10 日支付；应付信息披露费人民币 22,027.59 元，该款项将于取得信息披露费发票后支付；应付交易费用人民币 1,406.03 元，其中 1,276.18 元已于 2023 年 3 月 24 日支付，剩余款项 129.85 元将于取得缴费单据后支付；中债登账户维护费人民币 4,500.00 元，该款项已于 2023 年 3 月 24 日支付；上清所账户维护费为人民币 4,800.00 元，该款项已于 2023 年 3 月 24 日支付。

## 5.2 截至本次清算期结束日的剩余财产情况及剩余财产分配安排

| 项目                          | 金额                   |
|-----------------------------|----------------------|
| 一、最后运作日 2023 年 3 月 9 日基金净资产 | <b>19,726,012.62</b> |
| 减：2023 年 3 月 10 日确认赎回对价     | 1,164,196.94         |
| 加：清算期间净收益                   | 7,085.92             |
| 二、2023 年 4 月 11 日基金净资产      | <b>18,568,901.60</b> |

截至本次清算期结束日 2023 年 4 月 11 日，本基金剩余财产为人民币 18,568,901.60 元。自本次清算期结束日次日 2023 年 4 月 12 日至清算款划出前一日的收益和费用由基金份额持有人享有和承担。

本清算报告已经基金托管人复核，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时分配。

## 6、备查文件目录

### 6.1 备查文件目录

- 6.1.1 博时弘泰定期开放混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 6.1.2 关于博时弘泰定期开放混合型证券投资基金清算报告的法律意见书

### 6.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 6.3 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）

博时弘泰定期开放混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二三年四月十九日