

**博时鑫丰灵活配置混合型证券投资基金**  
**2017 年第 4 季度报告**  
**2017 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年一月二十日

## §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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 1 月 19 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 2017 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	博时鑫丰混合
基金主代码	003436
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 21 日
报告期末基金份额总额	597,751,038.26 份
投资目标	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，力争为基金持有人获取长期持续稳定的投资回报。
投资策略	<p>(一) 资产配置策略</p> <p>本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析互相补充的方法，在股票、债券和现金等资产类之间进行相对稳定的适度配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。</p> <p>(二) 债券投资策略</p> <p>本基金采用的债券投资策略包括：期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、可转换债券策略等。</p> <p>1、期限结构策略</p> <p>通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类型债券进行久期配置。具体策略又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。</p> <p>2、信用策略</p> <p>信用债收益率等于基准收益率加信用利差，信用利差收益主要受两个方面的影响，一是该信用债对应信用水平的市场平均信用利差曲线走势；二是该信用债本身的信用变化。基于这两方面的因素，本基金管理人分别采用（1）基于信用利差曲线变化策略和（2）基于信用债信用变化策略。</p> <p>3、互换策略</p> <p>不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面存在差别，投资管理人可以同时买入和卖出具有相近特性的两个或两</p>

	<p>个以上券种，赚取收益级差。</p> <p><b>4、息差策略</b> 通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，从而获得杠杆放大收益。</p> <p><b>5、可转换债券投资策略</b> 本基金利用宏观经济变化和上市公司的盈利变化，判断市场的变化趋势，选择不同的行业，再根据可转换债券的特性选择各行业不同的转债种。本基金利用可转换债券的债券底价和到期收益率来判断转债的债性，增强本金投资的相对安全性；利用可转换债券溢价率来判断转债的股性，在市场出现投资机会时，优先选择股性强的品种，获取超额收益。</p> <p><b>6、中小企业私募债券投资策略</b> 针对中小企业私募债券，本基金以持有到期，获得本金和票息收入为主要投资策略，同时，密切关注债券的信用风险变化，力争在控制风险的前提下，获得较高收益。</p> <p><b>（三）股票投资策略</b> 本基金股票投资以定性和定量分析为基础，从基本面分析入手，主要遵循以下三个步骤：</p> <p><b>（1）</b> 本基金将对股票的风格特征进行评估，从股票池中选择成长与价值特性突出的股票。 根据一系列指标对市场上所有股票的风格特征进行评估。成长股的重要评估指标是考察公司的成长性。价值投资的核心思想是寻找市场上被低估的股票。通过以上评估，初步筛选出成长与价值股票池。</p> <p><b>（2）</b> 对股票的基本面素质进行筛选，应用基本面分析方法，确定优质成长股与优质价值股的评价标准，在第一步选择出的具有鲜明风格的股票名单中，进一步分析，选出基本面较好的股票。</p> <p><b>（3）</b> 进行成长与价值的风格配置。本基金将根据对市场的判断，动态地调整成长股与价值股的投资比重，追求在可控风险前提下的稳健回报。 在以上形成的价值股、成长股股票池中，本基金根据对市场趋势的判断、宏观经济环境等因素，对成长与价值股的投资比例进行配置。总体而言，成长股与价值股在股票资产中进行相对均衡的配置，适度调整。以控制因风格带来的投资风险，降低组合波动的风险，提高整体收益率。</p> <p><b>（四）金融衍生品投资策略</b></p> <p><b>1、权证投资策略</b> 权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，力求稳健的投资收益。</p> <p><b>2、股指期货投资策略</b> 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p><b>（五）资产支持证券投资策略</b> 本基金将通过资产支持证券基础资产及结构设计的研究，结合多种定价模型，根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。未来随着证券市场投资工具的发展和丰富，在符合有关法律法规规定的前提下，本基金可相应调整和更新相关投资策略。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50% + 中证综合债指数收益率×50%
风险收益特征	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，属于中高收益/风险特征的基金。	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博时鑫丰混合 A	博时鑫丰混合 C
下属分级基金的交易代码	003436	003437
报告期末下属分级基金的份额总额	597,748,740.06 份	2,298.20 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 (2017 年 10 月 1 日-2017 年 12 月 31 日)	
	博时鑫丰混合 A	博时鑫丰混合 C
1.本期已实现收益	15,626,814.38	60.16
2.本期利润	5,204,771.05	27.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.0087	0.0116
4.期末基金资产净值	605,889,620.91	2,328.90
5.期末基金份额净值	1.014	1.013

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。

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。

本基金自 2017 年 2 月 14 日起新增 C 类份额。两类基金份额单独设置基金代码，分别公布基金资产净值、基金份额净值和基金累计份额净值等指标。

#### 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. 博时鑫丰混合A:

阶段	净值增长率 ①	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
过去三 个月	0.86%	0.16%	2.31%	0.41%	-1.45%	-0.25%

###### 2. 博时鑫丰混合C:

阶段	净值增长率 ①	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
过去三 个月	0.76%	0.16%	2.31%	0.41%	-1.55%	-0.25%

##### 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. 博时鑫丰混合A:



2. 博时鑫丰混合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		
王曦	基金经理	2016-12-21	-	9.5	2008 年加入博时基金管理有限公司。历任研究助理、投资分析员、研究员、投资助理、博时新起点混合基金、博时新趋势混合基金、博时混合基金的基金经理。现任博时新策略混合基金、博时新收益混合基金、博时新价值混合基金、博时鑫源混合基金、博时鑫瑞混合基金、博时鑫泽混合基金、博时鑫丰混合基金、博时鑫泰混合基金、博时鑫惠混合基金的基金经理。
杨永	股票投	2016-12-27	-	1	1993 年至 1997 年先

光	资部绝对收益组投资副总监/基金经理			6.3	<p>后在桂林电器科学研究所、深圳迈瑞生物医疗电子股份公司工作。2001 年起在国海证券历任债券研究员、债券投资经理助理、高级投资经理、投资主办人。2011 年加入博时基金管理有限公司，历任博时稳定价值债券基金、上证企债 30ETF 基金、博时天颐债券基金、博时招财一号保本基金、博时新机遇混合基金的基金经理、固定收益总部公募基金组投资副总监。现任股票投资部绝对收益组投资副总监兼博时优势收益信用债债券基金、博时境源保本混合基金、博时保泽保本混合基金、博时景兴纯债债券基金、博时保丰保本混合基金、博时保泰保本混合基金、博时招财二号保本基金、博时富宁纯债债券基金、博时富益纯债债券基金、博时臻选纯债债券基金、博时富华纯债债券基金、博时泰安债券基金、博时鑫丰混合基金、博时鑫泰混合基金、博时鑫惠混合基金、博时聚源纯债债券基金、博时广利纯债债券基金、博时富瑞纯债债券基金、博时富海纯债债券基金、博时华盈纯债债券基金的基金经理。</p>
---	-------------------	--	--	-----	--

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遵规守信情况的说明

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。

### 4.3 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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，2017 年第四季度经济表现平稳，PMI 指数波动不大，工业增加值增速略有回落。由于供给侧改革和环保监管影响，大宗商品继续有所上行，值得注意的是布伦特原油价格四季度上涨 17.85%，目前 CPI 表现尚平稳，在 1.7%左右的水平。

货币政策方面，四季度货币政策整体偏紧，叠加资管新规等因素影响，债券收益率大幅度上行，其中十年期国债从 9 月 30 日的 3.61%一度冲高到 4%，目前在 3.95%左右的水平。信用利差也有所扩大。股票市场波动较大，上证指数下跌 1.25%，创业板指数下跌 6.12%。

本基金四季度依然以防守为主，组合久期处于较低水平，配置上以高等级信用债和 NCD 为主。股票方面以金融、消费龙头配置为主，仓位略做调整。

展望 2018 年一季度，预计货币政策依然会维持在紧平衡状态，地产增速预计会有所回落，带动经济增速会有所下行，但韧性依然较强。2018 年开始对资管产品征收增值税，叠加一些信用事件冲击，预计信用利差会继续有所上行。

去杠杆仍然是 2018 年的主旋律。从流动性角度来看，预期仍然偏紧，估值较难有大幅提升。在这个大前提下，我们将选择估值低、流动性好、高 ROE 个股进行配置，赚取绝对收益。

2018 年仍是变革年，供给侧改革将持续，新兴产业继续得到支持，我们将在 5G、新能源车、生物药、半导体等板块进行研究，挖掘投资机会。

目前市场对流动性、经济增速、通胀等预期较为一致，需要密切关注其边际变化。

本基金对一季度债市谨慎乐观。操作上基本保持当前杠杆和久期，对低等级债券保持谨慎，精选个券并适当增可转债配置。预计股票结构性行情将会持续，随着部分公司业绩兑现，年报行情有望展开，组合将继续精选业绩优良的个券，争取为投资者创造更好的回报。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.014 元，份额累计净值为 1.053 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.013 元，份额累计净值为 1.050 元。报告期内，本基金 A 基金份额净值增长率为 0.86%，本基金 C 基金份额净值增长率为 0.76%，同期业绩基准增长率为 2.31%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在本报告期内，于 2017 年 11 月 2 日至 2017 年 12 月 18 日出现了连续 20 个工作日基金持有人数少于 200 人的情形。

## §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	33,399,224.92	4.95
	其中：股票	33,399,224.92	4.95
2	固定收益投资	495,938,460.50	73.57
	其中：债券	495,938,460.50	73.57
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	57,000,000.00	8.46
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付 金合计	59,261,948.92	8.79
7	其他各项资产	28,483,772.69	4.23
8	合计	674,083,407.03	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

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	-	-
B	采矿业	2,594,542.07	0.43
C	制造业	9,021,000.27	1.49
D	电力、热力、燃气及 水生产和供应业	459,101.87	0.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	677,595.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮 政业	2,447,253.94	0.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信 息技术服务业	733,220.00	0.12
J	金融业	13,809,935.77	2.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,656,576.00	0.60
M	科学研究和技术服务 业	-	-



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	-	-
	合计	33,399,224.92	5.51

### 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	815,268	5,054,661.60	0.83
2	002027	分众传媒	259,700	3,656,576.00	0.60
3	601988	中国银行	862,500	3,424,125.00	0.57
4	601336	新华保险	46,700	3,278,340.00	0.54
5	600887	伊利股份	81,600	2,626,704.00	0.43
6	600029	南方航空	203,800	2,429,296.00	0.40
7	601766	中国中车	172,900	2,093,819.00	0.35
8	600028	中国石化	330,500	2,025,965.00	0.33
9	601318	中国平安	22,400	1,567,552.00	0.26
10	600741	华域汽车	44,200	1,312,298.00	0.22

### 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	13,684,732.50	2.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	78,061,828.00	12.88
	其中：政策性金融债	19,996,000.00	3.30
4	企业债券	258,740,700.00	42.70
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,996,200.00	0.33
8	同业存单	143,455,000.00	23.68
9	其他	-	-
10	合计	495,938,460.50	81.85

### 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	143182	17 建材 01	500,000	48,920,000.00	8.07
2	111781016	17 湖北银行 CD089	500,000	48,190,000.00	7.95
3	111792761	17 青岛农商行 CD016	500,000	47,730,000.00	7.88
4	111799134	17 杭州银行 CD122	500,000	47,535,000.00	7.85

5	143132	17 浦土 01	400,000	39,452,000.00	6.51
---	--------	----------	---------	---------------	------

### 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

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

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** 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除 **17 湖北银行 CD089 (111781016)** 外，没有出现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。

2017 年 12 月 26 日，湖北银监局发布公告称，因湖北银行股份有限公司违反《中华人民共和国银行业监督管理法》的相关规定，湖北银行股份有限公司被湖北银监局处以罚款的行政处罚。

**5.11.2** 根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	59,174.59
2	应收证券清算款	17,054,589.03
3	应收股利	-
4	应收利息	11,370,009.07
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,483,772.69

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	---------	--------------

1	128015	久其转债	1,907,400.00	0.31
---	--------	------	--------------	------

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时鑫丰混合 A	博时鑫丰混合 C
本报告期期初基金份额总额	597,755,391.14	4,134.97
报告期基金总申购份额	18,078.92	94.98
减：报告期基金总赎回份额	24,730.00	1,931.75
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	597,748,740.06	2,298.20

## §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

基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

## §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	2017-10-01~2017-12-31	200,008,000.00	-	-	200,008,000.00	33.46%
	2	2017-10-01~2017-12-31	397,618,612.28	-	-	397,618,612.28	66.52%

#### 产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20% 的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份

额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20% 的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 50% 或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50% 时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

## 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”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2017 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 192 只开放式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户，管理资产总规模约 7587 亿元人民币，其中非货币公募基金规模约 2254 亿元人民币，累计分红逾 828 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，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

### 1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2017 年 4 季末：

权益基金方面，标准指数股票型基金里，博时上证 50ETF、博时深证基本面 200ETF 今年以来净值增长率分别为 30.41%、28.81%，同类排名分别为前 1/8 和前 1/6，博时裕富沪深 300 指数(A 类)今年以来净值增长率排名前 1/6；股票型分级子基金里，博时中证银行指数分级(B)今年以来净值增长率为 43.97%，同类基金中排名前 1/6；混合偏股型基金中，博时主题行业混合(LOF)今年以来净值增长率为 31.96%，同类基金排名位居前 1/6，博时行业轮动混合今年以来净值增长率为 27.90%，同类基金排名位居前 1/4；混合灵活配置型基金中，博时外延增长主题灵活配置混合基金今年以来净值增长率分别为 32.12%，同类基金排名位于前 1/12，博时互联网主题灵活配置混合、博时沪港深优质企业灵活配置混合(A 类)基金今年以来净值增长率分别为 23.79%、24.01%，同类基金中排名位于前 1/3。

黄金基金类，博时黄金 ETF(D 类)今年以来净值增长率 4.00%，同类排名第一。

固收方面，长期标准债券型基金中，博时裕盛纯债债券今年以来净值增长率为 3.63%，同类 170 只基金中排名前 10，博时聚润纯债债券今年以来净值增长率分别为 3.45%，同类基金排名位于前 1/10，博时裕昂纯债债券、博时裕创纯债债券等今年以来净值增长率排名前 1/8，博时裕安纯债债券、博时智臻纯债债券等今年以来净值增长率排名前 1/6；货币基金类，博时合利货币、博时外

服货币今年以来净值增长率分别为 4.26%、4.23%，在 227 只同类基金排名中位列第 8 位与第 11 位。

QDII 基金方面，博时亚洲票息收益债券(QDII)、博时亚洲票息收益债券(QDII) (美元)，今年以来净值增长率分别为 0.23%、6.38%，同类排名均位于前 2/4。

## 2、其他大事件

2017 年 12 月 13 日—12 月 15 日，由华尔街见闻主办的“2017 全球投资峰会及颁奖典礼活动”和由时代周报主办的“2017（南翔）年度盛典暨 2017‘金桔奖’颁奖典礼”在上海隆重举行。博时基金分别斩获“年度卓越公募基金”和“最佳财富管理机构”两项颇具份量的公司大奖。

2017 年 12 月 8 日，由经济观察报与上海国际信托有限公司联合主办的“观察家金融峰会”暨“2016-2017 中国卓越金融奖”颁奖典礼在北京召开，博时基金实力荣获“年度卓越综合实力基金公司”奖项。

2017 年 12 月 5 日，北京商报联手北京市品牌协会主办的“2017 北京金融论坛暨年度北京金融业十大品牌评选”在京揭晓。博时基金凭借优秀的品牌建设及卓越的品牌推广力，在本次论坛中荣获“品牌推广卓越奖”。

2017 年 11 月 27 日，由南方都市报和中国金融改革研究院共同主办的 2017 年（第三届）CFAC 中国金融年会在深召开，博时基金在此次大会上荣获“年度最佳基金公司大奖”，值得一提的是，这是博时基金第三次获得该项殊荣。

2017 年 11 月 24 日，由《新财富》杂志社主办的“第十五届新财富最佳分析师”评选颁奖盛典在深圳举行博时基金捧得新财富十五周年特别大奖——3i 最智慧投资机构。

2017 年 10 月 19 日，外汇交易中心公布 2017 年第三季度银行间本币市场活跃交易商名单。博时基金管理有限公司荣誉入选“债券市场活跃交易商”。

---

## §9 备查文件目录

---

### 9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证监会批准博时鑫丰灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 9.1.2 《博时鑫丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时鑫丰灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 9.1.5 报告期内博时鑫丰灵活配置混合型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

二〇一八年一月二十日