

**博时合鑫货币市场基金  
2019 年半年度报告摘要  
2019 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：二〇一九年八月二十七日

## § 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。本半年度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 2019 年 8 月 26 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金简称       | 博时合鑫货币              |
| 基金主代码      | 003206              |
| 交易代码       | 003206              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2016 年 10 月 12 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 | 17,069,108,523.24 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在控制投资组合风险，保持相对流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。                   |
| 投资策略   | 本基金将采用积极管理型的投资策略，在控制利率风险、尽量降低基金资产净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。  |
| 业绩比较基准 | 活期存款利率(税后)。  |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。 |

### 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<br>负责人 | 姓名   | 孙麒清                | 张燕                     |
|             | 联系电话 | 0755-83169999      | 0755-83199084          |
|             | 电子邮箱 | service@bosera.com | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话      |      | 95105568           | 95555                  |
| 传真          |      | 0755-83195140      | 0755-83195201          |

### 2.4 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人住所   |

## § 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（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日） |
| 本期已实现收益       | 228,676,857.90                       |

|                      |                         |
|----------------------|-------------------------|
| 本期利润                 | 228,676,857.90          |
| 本期净值收益率              | 1.3578%                 |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>报告期末(2019年6月30日)</b> |
| 期末基金资产净值             | 17,069,108,523.24       |
| 期末基金份额净值             | 1.0000                  |

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

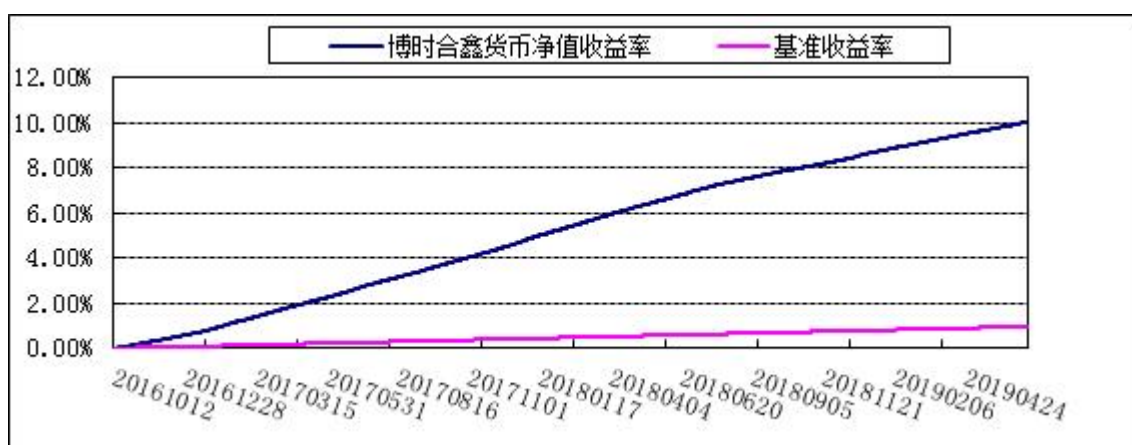
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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      | 0.2205%  | 0.0002%     | 0.0292%    | 0.0000%       | 0.1913% | 0.0002% |
| 过去三个月      | 0.6599%  | 0.0003%     | 0.0885%    | 0.0000%       | 0.5714% | 0.0003% |
| 过去六个月      | 1.3578%  | 0.0006%     | 0.1760%    | 0.0000%       | 1.1818% | 0.0006% |
| 过去一年       | 2.9072%  | 0.0012%     | 0.3549%    | 0.0000%       | 2.5523% | 0.0012% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.0504% | 0.0020%     | 0.9644%    | 0.0000%       | 9.0860% | 0.0020% |

注：基金收益分配是按日结转份额；本基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

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



## § 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”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2019 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 185 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，管理资产总规模逾 9345 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公募资产管理总规模逾

2699 亿元人民币，累计分红逾 980 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。

## 1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2019 年 2 季末：

博时旗下权益类基金业绩亮眼，54 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）今年来净值增长率银河同类排名在前 1/2，31 只银河同类排名在前 1/4，15 只银河同类排名在前 1/10，15 只银河同类排名在前 10。其中，博时回报灵活配置混合、博时乐臻定期开放混合、博时医疗保健行业混合今年来净值增长率分别在 145 只、61 只、14 只同类产品中排名第 1；博时量化平衡混合、博时弘泰定期开放混合、博时上证 50ETF 联接(A 类)、博时上证 50ETF 联接(C 类)、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(C 类) 今年来净值增长率分别在 102 只、61 只、46 只、34 只、15 只同类产品中排名第 3；博时特许价值混合(A 类) 今年来净值增长率在 414 只同类产品中排名第 20；博时鑫源灵活配置混合(C 类)、博时鑫源灵活配置混合(A 类)、博时上证 50ETF、博时新起点灵活配置混合(A 类)、博时颐泰混合(C 类)、博时睿利事件驱动灵活配置混合(LOF) 等基金今年来净值增长率排名在银河同类前 1/10；博时颐泰混合(A 类)、博时新兴消费主题混合、博时鑫瑞灵活配置混合(C 类)、博时新起点灵活配置混合(C 类)、博时鑫泽灵活配置混合(C 类)、博时文体娱乐主题混合、博时新兴成长混合、博时鑫瑞灵活配置混合(A 类)、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(A 类)、博时创新驱动灵活配置混合(C 类)、博时鑫泽灵活配置混合(A 类)、博时裕益灵活配置混合、博时沪港深优质企业灵活配置混合(A 类)、博时沪港深优质企业灵活配置混合(C 类) 等基金今年来净值增长率排名在银河同类前 1/4。

博时固定收益类基金业绩表现稳健，58 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）今年来净值增长率银河同类排名前 1/2，29 只银河同类排名在前 1/4，16 只银河同类排名在前 1/10，10 只银河同类排名在前 10。债券型基金中，博时转债增强债券(A 类)、博时转债增强债券(C 类) 今年来净值增长率分别在 28 只、15 只同类产品中排名第 1，且分别在全市场参与业绩排名的 1928 只债券基金中排名第 3、第 4；博时安盈债券(A 类)、博时安盈债券(C 类) 今年来净值增长率分别在同类产品中排第 2、第 3；博时安弘一年定期开放债券(A 类)、博时安康 18 个月定期开放债券(LOF)、博时安心收益定期开放债券(A 类)、博时岁岁增利一年定期开放债券、博时月月薪定期支付债券今年来净值增长率分别在 239 只同类产品中排名第 3、第 7、第 14、第 18、第 23；博时裕泰纯债债券、博时裕顺纯债债券、博时富瑞纯债债券、博时富祥纯债债券、博时裕腾纯债债券今年来净值增长率分别在 352 只同类产品中排名第 6、第 11、第 12、第 26、第 28；博时安弘一年定期开放债券(C 类) 今年来净值增长率在 58 只同类产品中排名第 3；博时信用债券(A/B 类)、博时信用债券(C 类) 今年来净值增长率在 228 只、163 只同类产品中均排名第 11；博时富兴纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时裕瑞纯债债券、博时裕创纯债债券、博时双月薪定期支付债券、博时安心收益定期开放债券(C 类)、博时裕盛纯债债券、博时裕恒纯债债券、博时裕盈纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时裕安纯债债券、博时安丰 18 个月定期开放债券(A 类-LOF) 等基金今年来净值增长率排名在银河同类前 1/4。货币型基金中，博时合惠货币(B 类) 今年来净值增长率在 296 只同类产品中排名第 8，博时合惠货币(A 类)、博时现金宝货币(B 类)、博时现金宝货币(A 类) 等基金今年来净值增长率排名在银河同类前 1/4。

商品型基金当中，博时黄金 ETF 今年来净值增长率同类排名第 3。

QDII 基金方面，博时标普 500ETF 今年来净值增长率同类排名第 2、博时亚洲票息收益债券、博时亚洲票息收益债券(美元) 今年来净值增长率均在同类排名第 7。

## 2、其他大事件

2019 年 6 月 20 日，由中国基金报独家主办的第六届中国基金业“英华奖”评选隆重揭晓，博时基金在此次英华奖中揽获 6 项最佳基金经理大奖。其中，博时基金蔡滨拿下“三年期股票投资最佳基金经理”；陈凯杨荣膺“五年期纯债投资最佳基金经理”；何凯则一举揽获“三年期海外固收投资最佳基金经理”和“五年期海外固收投资最佳基金经理”两项桂冠；过钧则再度获得“三年期二级债投资最佳基金经理”和“五年期二级债投资最佳基金经理”称号。

2019 年 4 月 25 日，由上海证券报主办的第十六届“金基金”奖的评选结果如期揭晓，博时基金在评选中一举夺得最具份量的公司奖项“2018 年度金基金•TOP 公司奖”，博时主题行业（160505）继去年获得“三年期金基金分红奖”后拿下“2018 年度金基金•十年期偏股混合型基金奖”，同时，博时裕瑞纯债债券（001578）获得“2018 年度金基金•一年期债券基金奖”。

2019 年 4 月 14 日，第十六届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，博时基金旗下绩优产品博时主题行业混合(L0F)（160505）荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖；博时信用债纯债债券（050027）荣获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2019 年 3 月 21 日，由证券时报主办的第六届中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛在北京隆重举行，同时第十四届中国基金业明星基金奖和中国公募基金首届英华奖也随之揭晓。博时基金凭借出色的资产管理能力和优秀的业绩表现，一举摘得“2018 年度十大明星基金公司”称号。在英华奖的评选中，博时基金在获评“2018 年度最佳电商业务发展基金公司”奖的同时，还凭借博时基金 20 周年品牌传播项目拿下了“2018 年度最佳营销策划案例（最佳综合）”奖。此外，博时慈善基金会公益助学项目获得了“2018 年度最佳社会公益实践案例”。在产品奖方面，助力央企结构转型和改革的博时央企结构调整 ETF 获评英华奖“2018 年度最佳创新基金产品”；博时裕瑞纯债债券获得“2018 年度普通债券型明星基金”奖；博时宏观回报债券则凭借同类可比基金第一的佳绩喜获“2018 年度积极债券型明星基金”奖；博时亚洲票息收益债券(QDII)、博时双月薪定期支付债券双双以过去五年稳居同类前列的好成绩分别拿下“五年持续回报 QDII 明星基金”、“五年持续回报普通债券型明星基金”称号；博时裕恒纯债债券则摘得“三年期持续回报普通债券型明星基金”。

2019 年 2 月 25 日，博时国际在“投资洞见与委托”（Insights&Mandate）举办的第二届专业投资奖评选活动中荣获“2019 年度最佳机构法人投资经理”，并凭借博时国际于 2018 年 5 月 10 日共同成立的“博时—东方红大中华债券基金”获“最佳创新产品”大奖。

2019 年 1 月 23 日，由深圳市福田区金融发展事务署首届举办的“香蜜湖金融科技创新奖”颁奖典礼在深圳福田隆重举行，《博时基金基于大数据技术升级量化投资技术》项目荣获优秀项目奖，博时基金采用金融科技为业务赋能的创新成果获得行业和地方政府高度认可。

2019 年 1 月 11 日，中央国债登记结算有限责任公司（以下简称“中债登”）公布了《2018 年度中

债优秀成员评选结果》。凭借在债券市场上的深厚积淀和优异的投研业绩，博时基金获评年度“优秀资产管理人”称号，全行业获此殊荣的基金公司仅有 10 家。

#### 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 |        |   |
| 鲁邦旺 | 基金经理 | 2019-02-25      | -    | 9.5    | 鲁邦旺先生，硕士。2008 年至 2016 年在平安保险集团公司工作，历任资金经理、固定收益投资经理。2016 年加入博时基金管理有限公司。历任博时裕丰纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2017 年 10 月 17 日)、博时裕和纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2017 年 10 月 19 日)、博时裕盈纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2017 年 10 月 25 日)、博时裕嘉纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2017 年 11 月 15 日)、博时裕坤纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2018 年 2 月 7 日)、博时裕晟纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2018 年 8 月 10 日)、博时安慧 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2017 年 12 月 29 日-2018 年 9 月 6 日)、博时裕康纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2019 年 3 月 11 日)、博时裕恒纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2019 年 3 月 11 日)、博时裕达纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2019 年 3 月 11 日)、博时裕泰纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2019 年 3 月 11 日)、博时裕瑞纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2019 年 3 月 11 日)、博时裕荣纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2019 年 3 月 11 日)、博时裕丰纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2017 年 10 月 18 日-2019 年 3 月 11 日)、博时裕盈纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2017 年 10 月 26 日-2019 年 3 月 11 日)、博时裕嘉纯债 3 个月定期 |

|    |                     |            |            |    |   |
|----|---------------------|------------|------------|----|---|
|    |                     |            |            |    | <p>开放债券型发起式证券投资基金(2017年11月16日-2019年3月11日)、博时裕坤纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018年2月8日-2019年3月11日)的基金经理。现任博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金(2016年12月15日一至今)、博时保证金实时交易型货币市场基金(2017年4月26日一至今)、博时天天增利货币市场基金(2017年4月26日一至今)、博时兴荣货币市场基金(2018年3月19日一至今)、博时富业纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018年7月2日一至今)、博时合鑫货币市场基金(2019年2月25日一至今)、博时外服货币市场基金(2019年2月25日一至今)、博时合晶货币市场基金(2019年2月25日一至今)、博时兴盛货币市场基金(2019年2月25日一至今)、博时合利货币市场基金(2019年2月25日一至今)的基金经理。</p>                      |
| 魏桢 | 固定收益总部现金管理组负责人/基金经理 | 2016-10-12 | 2019-02-25 | 11 | <p>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</p> |



|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>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)的基金经理。现任固定收益总部现金管理组负责人兼博时现金收益证券投资基金(2015 年 5 月 22 日-至今)、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-至今)、博时合惠货币市场基金(2017 年 5 月 31 日-至今)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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 上半年经济基本面呈现先上后下的走势，进入二季度后下行压力进一步凸显。从经济数据表现来看，6 月份规模以上工业增加值同比从年初 6.8% 回落至 6.3%；代表投资总需求的固定资产投资累计增速从 2 月份 6.1% 下行至 6 月份 5.8%，其中房地产投资、基建投资和制造业投资等分项均出现不同程度回落；出口增速受中美贸易摩擦影响由 1 月份 9.3% 大幅下降至 6 月份的 0.1%。金融数据大体平稳，M2 增速基本保持在 8.5% 左右，仅在 2 月份受春节因素拖累下行至 8.0%。一季度宽信用政策力度较大，带动 3 月和 4 月金融、经济数据表现好于其他时段，后续政策力度恢复至正常节奏后，总需求疲弱重新开始拖累经济。

上半年货币政策基调微观感受先紧后松。4 月份延续 2 月末以来的略偏紧态度，货币市场利率中枢小幅上行。5 月初中美贸易摩擦升级，下旬某些风险事件突发，出于平抑市场短期流动性风险和中小银行同业负债压力，货币政策基调重新调整至宽松。央行通过公开市场逆回购和增量续作 MLF 等手段向市场注入流动性，货币市场利率中枢快速下降，至 6 月下旬银行机构隔夜回购 DR001 利率跌破 1%，一度降至近 10 年来的最低位置。二季度期间银行间质押式回购 R001 和 R007 利率平均值分别为 2.09%、2.63%，较一季度平均值 2.22%、2.65% 回落 13bp 和 2bp。流动性持续宽松带来存款、存单等货币市场工具利率下移，截止 6 月末股份制银行 3M、6M 同业存单发行利率为 2.50%、2.60%，较一季度末下行 10-15bp。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金基金份额净值收益率为 1.3578%，同期业绩基准收益率为 0.1760%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年下半年，内需和外需疲弱格局料难改变，基本面潜在回落压力继续增大。宽信用、稳增长需要宽松流动性环境的配合，但在金融防风险仍然是政策主要立足点的前提下，定向降准、MLF、TMLF 等结构性放松政策大概率将取代“大水漫灌”，货币市场利率中枢下移但难以突破 2009 年宽松周期的水平，整体呈现“上有顶下有底”的小幅波动走势。

本基金预判货币市场利率走势，结合组合负债波动规律分析，适度调整资产到期现金流分布和大类资产比例。抓住季内货币市场利率高点积极拉长组合平均剩余期限，大力配置同业存单、存款及逆回购等资产，较好地提升了组合收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，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副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、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有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；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等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。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，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，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签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

收益分配原则：本基金每份基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式为红利再投资；本基金采用 1.00 元固定份额净值交易方式，自基金合同生效日起，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且定期进行结转。本基金的收益结转方式支持按日结转或按月结转，具体采用哪种方式以销售机构公布的为准。不论何种结转方式，当日收益均参与下一日的收益分配；本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资人不记收益；当进行收益结转时，如投资者的累计未结转收益为正，则为基金份额持有人增加相应的基金份额；如投资者的累计未结转收益为负，则为基金份额持有人缩减相应的基金份额，当投资人赎回基金份额时，将

按比例从赎回款中扣除，剩余部分缩减投资人的基金份额；如投资者的累计未结转收益等于零时，基金份额持有人的基金份额保持不变；当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会；如需召开基金份额持有人大会，为确保基金份额持有人的表决权体现其持有的权益，基金管理人将于召开基金份额持有人大会的权益登记日当日统一为基金份额持有人进行累计未结转收益的结转。

本基金本报告期内向份额持有人分配利润 228,676,857.90 元。

#### 4.8 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

托管人声明：

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。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、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：博时合鑫货币市场基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日         |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |                                |                                  |
| 银行存款            | 8,281,799,803.11               | 10,071,324,011.04                |
| 结算备付金           | -                              | -                                |
| 存出保证金           | -                              | -                                |
| 交易性金融资产         | 2,521,430,380.44               | 2,595,909,119.01                 |
| 其中：股票投资         | -                              | -                                |
| 基金投资            | -                              | -                                |
| 债券投资            | 2,521,430,380.44               | 2,595,909,119.01                 |
| 资产支持证券投资        | -                              | -                                |
| 贵金属投资           | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6,726,413,649.60               | 4,093,094,350.96                 |
| 应收证券清算款         | -                              | -                                |
| 应收利息            | 42,531,052.90                  | 85,860,983.06                    |
| 应收股利            | -                              | -                                |
| 应收申购款           | 300.00                         | 14,590.01                        |
| 递延所得税资产         | -                              | -                                |
| 其他资产            | -                              | -                                |
| 资产总计            | 17,572,175,186.05              | 16,846,203,054.08                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2019 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2018 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          | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       | 498,024,550.99                 | -                                |
| 应付证券清算款         | -                              | -                                |
| 应付赎回款           | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         | 2,101,976.23                   | 2,336,622.41                     |
| 应付托管费           | 700,658.73                     | 778,874.12                       |
| 应付销售服务费         | 420,395.28                     | 467,324.47                       |
| 应付交易费用          | 117,356.35                     | 132,175.03                       |
| 应交税费            | -                              | -                                |
| 应付利息            | 56,118.65                      | -                                |
| 应付利润            | 1,310,724.55                   | 2,326,210.33                     |
| 递延所得税负债         | -                              | -                                |
| 其他负债            | 334,882.03                     | 449,300.00                       |
| 负债合计            | 503,066,662.81                 | 6,490,506.36                     |
| <b>所有者权益：</b>   |                                |                                  |
| 实收基金            | 17,069,108,523.24              | 16,839,712,547.72                |
| 未分配利润           | -                              | -                                |
| 所有者权益合计         | 17,069,108,523.24              | 16,839,712,547.72                |
| 负债和所有者权益总计      | 17,572,175,186.05              | 16,846,203,054.08                |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 17,069,108,523.24 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时合鑫货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                         | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|--|---|
| <b>一、收入</b>                | <b>249,251,098.09</b>                    | <b>504,403,801.60</b>                         |
| 1. 利息收入                    | 249,252,139.36                           | 504,403,801.60                                |
| 其中：存款利息收入                  | 142,420,859.85                           | 307,525,782.71                                |
| 债券利息收入                     | 41,341,699.22                            | 78,389,269.49                                 |
| 资产支持证券利息收入                 | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入                 | 65,489,580.29                            | 118,488,749.40                                |
| 其他利息收入                     | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          | -1,041.27                                | -   |
| 其中：股票投资收益                  | -  | -   |
| 基金投资收益                     | -  | -   |
| 债券投资收益                     | -1,041.27                                | -   |
| 资产支持证券投资收益                 | -  | -   |
| 贵金属投资收益                    | -  | -   |
| 衍生工具收益                     | -  | -   |
| 股利收益                       | -  | -   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | -  | -   |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         | -  | -   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | -  | -   |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>20,574,240.19</b>                     | <b>27,782,205.07</b>                          |
| 1. 管理人报酬                   | 12,612,492.86                            | 17,365,158.53                                 |
| 2. 托管费                     | 4,204,164.27                             | 5,788,386.19                                  |
| 3. 销售服务费                   | 2,522,498.55                             | 3,473,031.71                                  |
| 4. 交易费用                    | -  | 1,514.50                                      |
| 5. 利息支出                    | 1,061,243.16                             | 889,689.33                                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 1,061,243.16                             | 889,689.33                                    |
| 6. 税金及附加                   | -  | -   |
| 7. 其他费用                    | 173,841.35                               | 264,424.81                                    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>228,676,857.90</b>                    | <b>476,621,596.53</b>                         |
| 减：所得税费用                    | -  | -   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>228,676,857.90</b>                    | <b>476,621,596.53</b>                         |

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时合鑫货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |       |         |
|----|---------------------------------------|-------|---------|
|    | 实收基金                                  | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
|    |                                       |       |         |

|  |  |                 |                   |
|--|--|-----------------|-------------------|
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 16,839,712,547.72                          | -               | 16,839,712,547.72 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 228,676,857.90  | 228,676,857.90    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 229,395,975.52                             | -               | 229,395,975.52    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 231,702,042.30                             | -               | 231,702,042.30    |
| 2. 基金赎回款                               | -2,306,066.78                              | -               | -2,306,066.78     |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -  | -228,676,857.90 | -228,676,857.90   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 17,069,108,523.24                          | -               | 17,069,108,523.24 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |                 |                   |
|  | 实收基金                                       | 未分配利润           | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 26,422,101,984.32                          | -               | 26,422,101,984.32 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 476,621,596.53  | 476,621,596.53    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -4,783,720,727.62                          | -               | -4,783,720,727.62 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 481,402,874.61                             | -               | 481,402,874.61    |
| 2. 基金赎回款                               | -5,265,123,602.23                          | -               | -5,265,123,602.23 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -  | -476,621,596.53 | -476,621,596.53   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 21,638,381,256.70                          | -               | 21,638,381,256.70 |

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：成江

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

(2) 对基金从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。

(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。

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

### 6.4.3 关联方关系

#### 6.4.3.1 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。

#### 6.4.3.2 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、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人、基金代销机构          |
| 招商证券股份有限公司（“招商证券”） | 基金管理人的股东、基金代销机构       |

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。

### 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

#### 6.4.4.2 关联方报酬

##### 6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|----|----------------------------|---------------------------------|
|    |                            |                                 |



|                 |               |               |
|-----------------|---------------|---------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 12,612,492.86 | 17,365,158.53 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 698.17        | 1,611.25      |

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 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

#### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2018年1月1日至2018年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,204,164.27         | 5,788,386.19         |

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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 × 0.05% / 当年天数。

#### 6.4.4.2.3 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               | 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|----------------|------------------|----------------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |                      |
| 博时基金直销中心       |                  | 2,522,143.94         |
| 招商银行           |                  | 110.67               |
| 合计             |                  | 2,522,254.61         |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间          | 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |                      |
| 博时基金           |                  | 3,472,241.67         |
| 招商银行           |                  | 195.84               |
| 合计             |                  | 3,472,437.51         |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.03% 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 = 前一日基金资产净值 × 0.03% / 当年天数。

#### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期                   |        |      |                |            |                  |            |
|----------------------|--------|------|----------------|------------|------------------|------------|
| 2019年1月1日至2019年6月30日 |        |      |                |            |                  |            |
| 银行间市场交易的各关联方名称       | 债券交易金额 |      | 基金逆回购          |            | 基金正回购            |            |
|                      | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额           | 利息收入       | 交易金额             | 利息支出       |
| 招商银行                 | -      | -    | -              | -          | 503,000,000.00   | 31,871.77  |
| 上年度可比期间              |        |      |                |            |                  |            |
| 2018年1月1日至2018年6月30日 |        |      |                |            |                  |            |
| 银行间市场交易的各关联方名称       | 债券交易金额 |      | 基金逆回购          |            | 基金正回购            |            |
|                      | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额           | 利息收入       | 交易金额             | 利息支出       |
| 招商银行                 | -      | -    | 490,000,000.00 | 356,240.89 | 1,671,622,000.00 | 119,866.33 |

#### 6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

#### 6.4.4.4.2 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。

#### 6.4.4.5 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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018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  | 3,799,803.11               | 37,560.44 | 3,976,595.11                    | 26,162.41 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，按约定利率计息。

#### 6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.5 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 498,024,550.99 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称       | 回购到期日      | 期末估值单价 | 数量（张）        | 期末估值总额         |
|--------|------------|------------|--------|--------------|----------------|
| 180018 | 18 付息国债 18 | 2019-07-01 | 100.06 | 2,175,000.00 | 217,630,500.00 |
| 199916 | 19 贴现国债 16 | 2019-07-01 | 99.88  | 3,100,000.00 | 309,628,000.00 |
| 合计     |            |            |        | 5,275,000.00 | 527,258,500.00 |

###### 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 2,521,430,380.44 元，无属于第一或第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第二层次的余额为 2,595,909,119.01 元，无属于第一或第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，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  | 固定收益投资            | 2,521,430,380.44  | 14.35         |
|    | 其中：债券             | 2,521,430,380.44  | 14.35         |
|    | 资产支持证券            | -                 | -             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 6,726,413,649.60  | 38.28         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                 | -             |
| 3  | 银行存款和结算备付金合计      | 8,281,799,803.11  | 47.13         |
| 4  | 其他各项资产            | 42,531,352.90     | 0.24          |
| 5  | 合计                | 17,572,175,186.05 | 100.00        |

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例 (%) |
|----|----|----------------|
|----|----|----------------|

|    |              |                |                |
|----|--------------|----------------|----------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 0.60           |                |
|    | 其中：买断式回购融资   | -              |                |
| 序号 | 项目           | 金额             | 占基金资产净值的比例 (%) |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | 498,024,550.99 | 2.92           |
|    | 其中：买断式回购融资   | -              | -              |

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内没有债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 39 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 59 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 29 |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限没有超过 120 天的情况。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限                 | 各期限资产占基金资产净值的比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值的比例 (%) |
|----|------------------------|---------------------|---------------------|
| 1  | 30 天以内                 | 44.87               | 2.92                |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 17.97               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 39.85               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | -                   | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | -                   | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
|    | 合计                     | 102.70              | 2.92                |

### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种                 | 摊余成本             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------------------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券                 | 759,361,678.80   | 4.45         |
| 2  | 央行票据                 | -                | -            |
| 3  | 金融债券                 | 120,126,921.14   | 0.70         |
|    | 其中：政策性金融债            | 120,126,921.14   | 0.70         |
| 4  | 企业债券                 | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券              | -                | -            |
| 6  | 中期票据                 | -                | -            |
| 7  | 同业存单                 | 1,641,941,780.50 | 9.62         |
| 8  | 其他                   | -                | -            |
| 9  | 合计                   | 2,521,430,380.44 | 14.77        |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -                | -            |

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

## 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 债券数量(张)   | 摊余成本           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 111909174 | 19 浦发银行 CD174 | 5,000,000 | 497,028,105.46 | 2.91         |
| 2  | 111905067 | 19 建设银行 CD067 | 4,000,000 | 397,526,002.04 | 2.33         |
| 3  | 199916    | 19 贴现国债 16    | 3,100,000 | 309,617,614.63 | 1.81         |
| 4  | 180018    | 18 付息国债 18    | 2,200,000 | 220,129,412.63 | 1.29         |
| 5  | 111998147 | 19 天津银行 CD101 | 2,000,000 | 199,155,069.16 | 1.17         |
| 6  | 111998722 | 19 九江银行 CD068 | 2,000,000 | 199,052,793.60 | 1.17         |
| 7  | 111903078 | 19 农业银行 CD078 | 1,500,000 | 149,755,116.96 | 0.88         |
| 8  | 199917    | 19 贴现国债 17    | 1,200,000 | 119,794,261.36 | 0.70         |
| 9  | 111996413 | 19 宁波银行 CD071 | 1,000,000 | 99,840,090.70  | 0.58         |
| 10 | 111883113 | 18 宁波银行 CD154 | 1,000,000 | 99,584,602.58  | 0.58         |

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

## 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目                            | 偏离情况     |
|-------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 | 0        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0120%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0059% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0048%  |

注：上表中“偏离情况”根据报告期内各交易日数据计算。

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明

本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持 1.00 元。

**7.9.2 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除 19 浦发银行 CD174（111909174）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。**

2018 年 8 月 1 日，因存在未按照规定履行客户身份识别义务等违规行为，中国人民银行对上海浦东发展银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

对该证券投资决策程序的说明：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。

#### 7.9.3 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  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收利息    | 42,531,052.90 |
| 4  | 应收申购款   | 300.00        |
| 5  | 其他应收款   | -             |
| 6  | 待摊费用    | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 42,531,352.90 |

#### 7.9.4 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

| 持有人户数(户) | 户均持有的基 | 持有人结构 |
|----------|--------|-------|
|----------|--------|-------|

|       | 金份额          | 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 |
| 4,134 | 4,128,957.07 | 17,065,952,706.52 | 99.98% | 3,155,816.72 | 0.02%  |

## 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额（份）           | 占总份额比例 |
|----|-------|-------------------|--------|
| 1  | 银行类机构 | 17,065,952,599.48 | 99.98% |
| 2  | 个人    | 231,469.07        | 0.00%  |
| 3  | 个人    | 230,151.47        | 0.00%  |
| 4  | 个人    | 150,030.61        | 0.00%  |
| 5  | 个人    | 108,738.15        | 0.00%  |
| 6  | 个人    | 100,089.85        | 0.00%  |
| 7  | 个人    | 97,173.49         | 0.00%  |
| 8  | 个人    | 69,226.03         | 0.00%  |
| 9  | 个人    | 54,331.80         | 0.00%  |
| 10 | 个人    | 52,682.06         | 0.00%  |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | 21,188.45 | 0.00%    |

## 8.4 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                                 | 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<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | -                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | -                 |

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人未持有本基金；  
2、本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                   |
|----------------------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2016年10月12日）基金份额总额 | 200,322,870.81    |
| 本报告期初基金份额总额                | 16,839,712,547.72 |
| 本报告期基金总申购份额                | 231,702,042.30    |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 2,306,066.78      |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -                 |
| 本报告期末基金份额总额                | 17,069,108,523.24 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、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 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（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

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

### 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 |    |
| 中信建投 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国泰君安 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能



及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

### 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             |              | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|------------------|--------------|------|--------------|
|      | 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 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信建投 | -    | -            | -                | -            | -    | -            |
| 国泰君安 | -    | -            | 4,891,000,000.00 | 100.00%      | -    | -            |

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

本基金在本报告期内不存在偏离度绝对值在 0.5%（含）以上的情况。

## § 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

| 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              | 2019-01-01~2019-06-30    | 16,836,303,925.99 | 229,648,673.49 | -    | 17,065,952,599.48 | 99.98% |

#### 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。

注：申购份额包含红利再投资份额。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

博时基金管理有限公司  
二〇一九年八月二十七日