

**博时合惠货币市场基金
2019 年第 3 季度报告
2019 年 9 月 30 日**

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年十月二十三日

§ 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 2019 年 10 月 22 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 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	博时合惠货币	
基金主代码	004137	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 1 月 13 日	
报告期末基金份额总额	66,032,979,836.98 份	
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。	
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	博时合惠货币 A	博时合惠货币 B
下属分级基金的交易代码	004841	004137
报告期末下属分级基金的份额总额	9,391,511,829.12 份	56,641,468,007.86 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(2019年7月1日-2019年9月30日)	
	博时合惠货币 A	博时合惠货币 B
1.本期已实现收益	66,258,726.01	400,883,639.45
2.本期利润	66,258,726.01	400,883,639.45
3.期末基金资产净值	9,391,511,829.12	56,641,468,007.86

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 本报告期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

1. 博时合惠货币A:

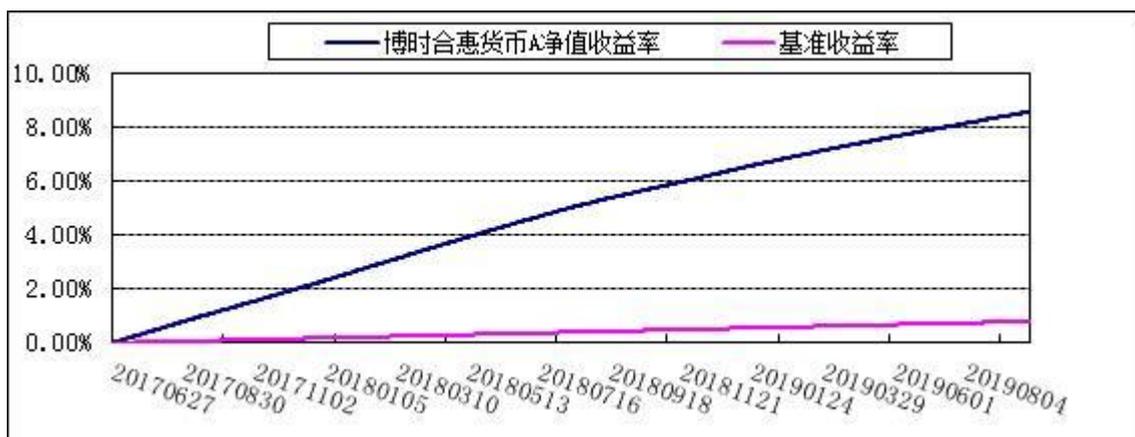
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6486%	0.0004%	0.0894%	0.0000%	0.5592%	0.0004%

2. 博时合惠货币B:

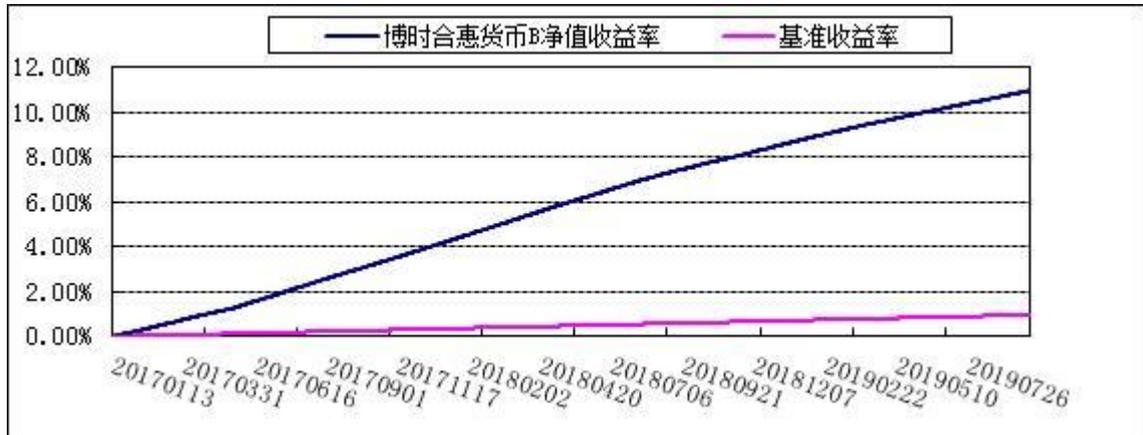
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7096%	0.0004%	0.0894%	0.0000%	0.6202%	0.0004%

3.2.2 自基金合同生效以来 基金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

1. 博时合惠货币A



2. 博时合惠货币B



§ 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		
陈凯杨	公司董事 总经理/固定收益总部 公募基金组 负责人/基金经理	2017-05-31	-	14.0	陈凯杨先生，硕士。2003年起先后在深圳发展银行、博时基金、长城基金工作。2009年1月再次加入博时基金管理有限公司。历任固定收益研究员、特定资产投资经理、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)基金经理、固定收益总部现金管理组投资副总监、博时外服货币市场基金(2015年6月15日-2016年7月20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12月15日)、博时裕瑞纯债债券型证券投资基金(2015年6月30日-2016年12月15日)、博时裕盈纯债债券型证券投资基金(2015年9月29日-2016年12月15日)、博时裕恒纯债债券型证券投资基金(2015年10月23日-2016年12月15日)

					日)、博时裕荣纯债债券型证券投资基金(2015 年 11 月 6 日-2016 年 12 月 15 日)、博时裕晟纯债债券型证券投资基金(2015 年 11 月 19 日-2016 年 12 月 27 日)、博时裕泰纯债债券型证券投资基金(2015 年 11 月 19 日-2016 年 12 月 27 日)、博时裕丰纯债债券型证券投资基金(2015 年 11 月 25 日-2016 年 12 月 27 日)、博时裕和纯债债券型证券投资基金(2015 年 11 月 27 日-2016 年 12 月 27 日)、博时裕坤纯债债券型证券投资基金(2015 年 11 月 30 日-2016 年 12 月 27 日)、博时裕嘉纯债债券型证券投资基金(2015 年 12 月 2 日-2016 年 12 月 27 日)、博时裕达纯债债券型证券投资基金(2015 年 12 月 3 日-2016 年 12 月 27 日)、博时裕康纯债债券型证券投资基金(2015 年 12 月 3 日-2016 年 12 月 27 日)、博时安心收益定期开放债券型证券投资基金(2012 年 12 月 6 日-2016 年 12 月 28 日)、博时裕腾纯债债券型证券投资基金(2016 年 1 月 18 日-2017 年 5 月 8 日)、博时裕安纯债债券型证券投资基金(2016 年 3 月 4 日-2017 年 5 月 8 日)、博时裕新纯债债券型证券投资基金(2016 年 3 月 30 日-2017 年 5 月 8 日)、博时裕发纯债债券型证券投资基金(2016 年 4 月 6 日-2017 年 5 月 8 日)、博时裕景纯债债券型证券投资基金(2016 年 4 月 28 日-2017 年 5 月 8 日)、博时裕乾纯债债券型证券投资基金(2016 年 1 月 15 日-2017
--	--	--	--	--	--

				<p> 年 5 月 31 日)、博时裕通纯债债券型证券投资基金(2016 年 4 月 29 日-2017 年 5 月 31 日)、博时安和 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2016 年 1 月 26 日-2017 年 10 月 26 日)、博时安源 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2016 年 6 月 16 日-2018 年 3 月 8 日)、博时安誉 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2015 年 12 月 23 日-2018 年 3 月 15 日)、博时安泰 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2016 年 2 月 4 日-2018 年 3 月 15 日)、博时安祺一年定期开放债券型证券投资基金(2016 年 9 月 29 日-2018 年 3 月 15 日)、博时安诚 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2016 年 11 月 10 日-2018 年 5 月 28 日)、博时裕信纯债债券型证券投资基金(2016 年 10 月 25 日-2018 年 8 月 23 日)的基金经理、固定收益总部现金管理组负责人、博时现金收益证券投资基金(2015 年 5 月 22 日-2019 年 2 月 25 日)、博时裕顺纯债债券型证券投资基金(2016 年 6 月 23 日-2019 年 8 月 19 日)的基金经理。现任公司董事总经理兼固定收益总部公募基金组负责人、博时月月薪定期支付债券型证券投资基金(2013 年 7 月 25 日—至今)、博时双月薪定期支付债券型证券投资基金(2013 年 10 月 22 日—至今)、博时安瑞 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2016 年 3 月 30 日—至今)、博时安怡 6 个月定期开放债券型证券投资基金 </p>
--	--	--	--	---

				<p>(2016 年 4 月 15 日—至今)、博时裕弘纯债债券型证券投资基金(2016 年 6 月 17 日—至今)、博时裕昂纯债债券型证券投资基金(2016 年 7 月 15 日—至今)、博时裕泉纯债债券型证券投资基金(2016 年 9 月 7 日—至今)、博时裕诚纯债债券型证券投资基金(2016 年 10 月 31 日—至今)、博时安康 18 个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)(2017 年 2 月 17 日—至今)、博时合惠货币市场基金(2017 年 5 月 31 日—至今)、博时富益纯债债券型证券投资基金(2018 年 5 月 9 日—至今)、博时富华纯债债券型证券投资基金(2018 年 9 月 19 日—至今)、博时聚瑞纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 11 月 22 日—至今)、博时裕创纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日—至今)、博时富发纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日—至今)、博时裕盛纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 4 日—至今)、博时裕恒纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 11 日—至今)、博时裕瑞纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 11 日—至今)、博时裕泰纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 11 日—至今)、博时裕荣纯债债券型证券投资基金(2019 年 3 月 11 日—至今)、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(2019 年 3 月 11 日—至今)、博时富乐纯债债券型证券投资基金(2019 年 9 月 17 日—至今)</p>
--	--	--	--	--

					的基金经理。
魏桢	固定收益 总部现金管 理组负责人 /基金经理	2017-05-31	-	11.3	<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</p>

				<p>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 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

三季度经济数据显示宏观经济下行压力较上半年进一步增大。具体来看，规模以上工业增加值同比增长从二季度末 6.3% 下行至 8 月份 4.4%。代表投资需求的固定资产投资累计同比增速从 6 月份 5.8% 跌至 8 月份 5.5%，主要受房地产投资和制造业投资分项同时小幅回落的拖累。8 月份出口累计增速 0.4%，较二季度末 0.1% 略有回暖。金融数据表现平平，8 月 M2 增速 8.2%，较二季度均值 8.5% 继续下行；新增社融规模整体平稳，其中企业中长期贷款占比边际略有改善。经济和金融数据反映经济仍处于下行通道中，信用扩张尚未出现显著改善信号。通胀方面，猪肉价格快速上涨带动 CPI 上行至 2.80%，较上半年大幅上行。

三季度期间货币政策强调“以我为主”，进一步放松的定力较强，货币政策基调相比二季度边际收紧。尽管经济基本面下行风险加大，但下行速度仍在可承受范围内，同时通胀上行压力凸显、人民币汇率等成为制约货币放松的新变量，央行无意进行新一轮放松。9 月全面下调金融机构存款准备金率 0.5 个百分点，但随后通过 MLF 缩量续作和公开市场净回笼等方式对冲了部分降准释放的流动性，因此流动性环境并未变得更加宽裕。表现在资金利率方面，三季度银行间质押式回购 R001 和 R007 利率均值分别为 2.40%、2.70%，较二季度平均值 2.09%、2.63% 分别提高 31bp 和 7bp。

展望 2019 年四季度，总需求疲弱格局将延续，宏观经济仍然面临下行风险。猪肉价格处于上涨趋势中，有望推高四季度 CPI 超过 3%。经济小幅向下、通胀快速向上的经济基本面格局将继续对货

币政策放松形成制约，定向降准、MLF、TMLF 等数量型结构性放松政策仍是主要工具。下调 MLF、公开市场逆回购甚至存贷款利率等价格型宽松政策大概率会在经济出现失速下行风险时使用，四季度出现的概率并不高。预计货币政策将维持第三季度的稳健基调，叠加年末银行考核因素，货币市场利率较三季度小幅提升。

本基金预判货币市场利率走势，适度调整资产到期现金流分布，利用季末月货币市场利率高点拉长组合平均剩余期限，配置同业存单、存款及逆回购等资产，根据流动性松紧灵活调整组合杠杆，在保证流动性充足的同时较好地提升了组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 基金份额净值收益率为 0.6486%，本基金 B 基金份额净值收益率为 0.7096%，同期业绩基准收益率 0.0894%。

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	固定收益投资	32,756,896,343.07	46.61
	其中：债券	32,681,896,343.07	46.50
	资产支持证券	75,000,000.00	0.11
2	基金投资	-	-
3	买入返售金融资产	5,535,918,703.88	7.88
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
4	银行存款和结算备付金合计	31,826,204,500.14	45.29
5	其他资产	158,792,353.16	0.23
6	合计	70,277,811,900.25	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.74	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)

2	报告期末债券回购融资余额	4,223,862,637.05	6.40
	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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	92
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	81

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期末未出现平均剩余期限超过 120 天的情况。

5.3.2 报告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	23.65	6.40
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	20.20	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	34.98	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	1.89	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	25.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		106.19	6.40

5.4 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期限未超过 240 天

5.5 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	1,976,904,735.15	2.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,500,875,109.08	2.27
	其中：政策性金融债	1,500,875,109.08	2.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	29,204,116,498.84	44.23
8	其他	-	-
9	合计	32,681,896,343.07	49.49
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111907147	19 招商银行 CD147	20,000,000	1,949,909,066.30	2.95
2	111912069	19 北京银行 CD069	20,000,000	1,948,852,970.67	2.95
3	111903066	19 农业银行 CD066	15,000,000	1,490,030,228.65	2.26
4	111907095	19 招商银行 CD095	11,000,000	1,093,354,317.07	1.66
5	111908120	19 中信银行 CD120	11,000,000	1,093,138,562.73	1.66
6	111906173	19 交通银行 CD173	11,000,000	1,092,960,097.19	1.66
7	111904040	19 中国银行 CD040	11,000,000	1,092,926,705.04	1.66
8	111907099	19 招商银行 CD099	11,000,000	1,092,829,814.67	1.65
9	111912071	19 北京银行 CD071	11,000,000	1,080,557,006.40	1.64
10	111914153	19 江苏银行 CD153	11,000,000	1,080,366,278.70	1.64

5.7 “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 次
报告期内偏离度的最高值	0.0724%
报告期内偏离度的最低值	0.0334%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0493%

注：上表中“偏离情况”根据报告期内各工作日数据计算。

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超过 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超过 0.5%。

5.8 报告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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	139879	国链 11A2	390,000.00	39,000,000.00	0.06
2	139878	国链 11A1	360,000.00	36,000,000.00	0.05

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除 19 北京银行 CD069(111912069)、19 北京银行 CD071(111912071)、19 交通银行 CD173(111906173)、19 招商银行 CD095(111907095)、19 招商银行 CD099(111907099)、19 招商银行 CD147(111907147)、19 中国银行 CD040(111904040)、19 中信银行 CD120(111908120)的发行主体外，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。

2019 年 9 月 11 日，因存在个人消费贷款被挪用于支付购房首付款或投资股权等违规行为，中国银行业监督管理委员会北京监管局对北京银行处以罚款的行政处罚。

2019 年 8 月 23 日，因存在高管及员工监督管理不到位等违规行为，中国银行业监督管理委员会四川监管局对交通银行股份有限公司四川省分行处以罚款的行政处罚。

2019 年 5 月 23 日，因存在表内并购贷款等违规行为，中国银行业监督管理委员会厦门监管局对招商银行厦门分行处以罚款的行政处罚。

2019 年 3 月 22 日，因存在向关系人发放信用贷款等违规行为，中国银行业监督管理委员会山东监管局对中国银行股份有限公司山东省分行处以罚款的行政处罚。

2019 年 8 月 9 日，因存在未按规定提供报表且逾期未改正等违规行为，中国银行保险监督管理委员会对中信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。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	146,444,777.12
4	应收申购款	12,347,576.04
5	其他应收款	-

6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	158,792,353.16

5.9.4 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时合惠货币 A	博时合惠货币 B
本报告期期初基金份额总额	11,403,743,779.59	55,973,369,698.62
报告期基金总申购份额	2,836,083,920.48	17,820,071,934.99
报告期基金总赎回份额	4,848,315,870.95	17,151,973,625.75
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	9,391,511,829.12	56,641,468,007.86

§ 7 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	申购	2019-07-04	140,000,000.00	140,000,000.00	0.00%
2	赎回	2019-07-11	-60,000,000.00	-60,000,000.00	0.00%
3	赎回	2019-07-19	-80,125,411.40	-80,125,411.40	0.00%
4	申购	2019-08-06	140,000,000.00	140,000,000.00	0.00%
5	赎回	2019-08-13	-30,000,000.00	-30,000,000.00	0.00%
6	赎回	2019-08-22	-40,000,000.00	-40,000,000.00	0.00%
7	申购	2019-09-05	150,000,000.00	150,000,000.00	0.00%
8	赎回	2019-09-19	-40,000,000.00	-40,000,000.00	0.00%
9	赎回	2019-09-30	-20,000,000.00	-20,000,000.00	0.00%
合计			159,874,588.60	159,874,588.60	

§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

无。

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 2019 年 9 月 30 日，博时基金公司共

管理 191 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、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 10059 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 2976 亿元人民币，累计分红逾 1154 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 3 季末：

博时旗下权益类基金业绩持续优异，73 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）今年来净值增长率超过 20%，33 只产品净值增长率超过 30%，4 只产品净值增长率超过 60%，1 只产品净值增长率超过 80%；61 只产品今年来净值增长率银河同类排名在前 1/2，25 只产品银河同类排名在前 1/4，11 只产品银河同类排名在前 10，2 只产品银河同类排名第 1。其中，博时医疗保健行业混合、博时回报灵活配置混合双双同类排名第 1，博时弘泰定期开放混合、博时荣享回报灵活配置定期开放混合（C 类）双双同类排名第 2，博时文体娱乐主题混合、博时乐臻定期开放混合、博时特许价值混合（A 类）、博时荣享回报灵活配置定期开放混合（A 类）、博时丝路主题股票（C 类）、博时中证银联智慧大数据 100 指数（C 类）、博时上证 50ETF 联接（C 类）分别在银河数据同类排名前十。博时睿利事件驱动灵活配置混合（LOF）、博时鑫泽灵活配置混合（C 类）今年来净值增长率同类排名在前 1/10，博时量化平衡混合、博时新兴消费主题混合、博时互联网主题灵活配置混合、博时上证 50ETF 联接（A 类）、博时新兴成长混合、博时裕益灵活配置混合、博时鑫源灵活配置混合（C 类）、博时鑫泽灵活配置混合（A 类）、博时厚泽回报灵活配置混合（C 类）、博时创新驱动灵活配置混合（C 类）、博时鑫源灵活配置混合（A 类）、博时鑫瑞灵活配置混合（C 类）、博时沪港深优质企业灵活配置混合（C 类）、博时颐泰混合（C 类）、博时新起点灵活配置混合（C 类）等产品今年来净值增长率同类排名均在前 1/4。

博时固定收益类基金同样表现突出，29 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）今年来净值增长率超过 4%，8 只产品净值增长率超过 6%，4 只产品净值增长率超过 10%，2 只产品净值增长率超过 20%；57 只产品今年来净值增长率银河同类排名在前 1/2，34 只产品银河同类排名在前 1/4，16 只产品银河同类排名在前 1/10，13 只产品银河同类排名在前 10，4 只产品银河同类排名第 3。其中，博时安盈债券（A 类）今年来净值增长率同类排名第 2，博时转债增强债券（C 类）、博时安康 18 个月定期开放债券（LOF）、博时安弘一年定期开放债券（C 类）今年来净值增长率同类排名均在第 3，博时转债增强债券（A 类）、博时安盈债券（C 类）、博时安弘一年定期开放债券（A 类）今年来净值增长率同类排名均在第 4，博时裕腾纯债债券、博时富瑞纯债债券今年来净值增长率在 344 只同类产品中分别排名第 5、第 7，博时合惠货币（B 类）、博时安心收益定期开放债券（C 类）、博时裕顺纯债债券、博时信用债纯债债券（C 类）今年来净值增长率分别再在 294 只、58 只、344 只、151 只同类产品中排名第 8、第 9、第 10、第 10。博时信用债纯债债券（A 类）、博时信用债券（A/B 类）、博时信用债券（C 类）、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、博时裕创纯债债券、博

时富兴纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时裕安纯债债券、博时合惠货币 (A 类) 等产品今年以来净值增长率同类排名在前 1/10, 博时月月薪定期支付债券、博时双月薪定期支付债券、博时现金宝货币 (A 类)、博时现金宝货币 (B 类)、博时安丰 18 个月定期开放债券 (A 类-LOF)、博时富祥纯债债券、博时裕泰纯债债券、博时裕盈纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时富腾纯债债券、博时合鑫货币、博时聚瑞纯债 6 个月定期开放债券发起式、博时兴荣货币、博时裕恒纯债债券、博时外服货币等产品今年以来净值增长率同类排名在前 1/4。

博时旗下 QDII 基金继续表现突出, 博时标普 500ETF、博时标普 500ETF 联接 (C 类)、博时标普 500ETF 联接 (A 类) 今年以来净值增长率均超过 20%, 同类排名分别为第 2、第 5、第 11; 博时亚洲票息收益债券 (人民币) 今年以来净值增长率超过 10%, 同类排名第 6。

商品型基金当中, 博时黄金 ETF 今年以来较好跟上黄金上涨行情, 净值增长率超过 20%, 同类排名第 3。

2、其他大事件

2019 年 9 月 27 日, 《证券时报》主办的“2019 中国 AI 金融探路者峰会暨第三届中国金融科技先锋榜”颁奖典礼在深圳举行, 博时基金凭借“新一代投资决策支持平台”项目, 获登“中国公募基金智能投研先锋榜”。

2019 年 8 月 17 日, 第二届济安五星基金“群星汇”暨颁奖典礼在京举行, 博时基金斩获基金公司综合奖“群星奖”、“众星奖”、“五星奖”, 基金产品单项奖“货币型基金管理奖”、“QDII 基金管理奖”以及 2 项“五星基金明星奖”等 7 项大奖, 彰显出老牌基金公司强大的实力底蕴。

2019 年 7 月 5 日, 2019 金牛基金高峰论坛暨第十六届中国基金金牛奖颁奖典礼在北京进行, 博时基金研究部总经理王俊和固定收益总部专户组投资总监张李陵分别获得“人气金牛”奖项, 两位各自管理的绩优产品博时主题行业混合 (LOF) (160505) 和博时信用债纯债债券 (050027) 分别荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖和“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

§ 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合惠货币市场基金设立的文件
- 9.1.2 《博时合惠货币市场基金基金合同》
- 9.1.3 《博时合惠货币市场基金托管协议》
- 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 博时合惠货币市场基金各年度审计报告正本
- 9.1.6 报告期内博时合惠货币市场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
二〇一九年十月二十三日