

**博时量化价值股票型证券投资基金**  
**2019 年第 4 季度报告**  
**2019 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年一月十七日

## §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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 1 月 15 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	博时量化价值股票
基金主代码	005960
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 6 月 26 日
报告期末基金份额总额	429,295,435.09 份
投资目标	本基金运用量化方法，主要从市场相对估值、历史相对估值和重要股东增持价格三个方向衡量上市公司的估值高低，设计相应的量化策略选出具有估值优势的股票进行投资，力求获取超额收益。
投资策略	<p>1、A 股投资策略：本基金运用量化方法进行价值型投资，本基金管理人以自主研发的量化多策略体系为基础，对其中的价值型策略进行集中配置，在控制其他风格暴露的情况下突出组合的价值风格，获取长期超越市场的回报。</p> <p>2、港股投资策略：本基金将充分挖掘内地与香港股票市场交易互联互通、资金双向流动机制下 A 股市场和港股市场的投资机会。</p> <p>3、债券投资策略：由于流动性管理及策略性投资的需要，本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益类证券以及可转换债券的投资。</p> <p>4、资产支持证券的投资策略：本基金投资资产支持证券将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同，在力争本金安全和基金资产流动性基础上获得长期稳定收益。</p> <p>5、权证投资策略 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、实现保值和锁定收益。</p> <p>6、股指期货投资策略 本基金现阶段主要通过股指期货合约调节整体组合的市场风险。</p> <p>7、国债期货投资策略 本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合</p>

	约。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%。	
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于中高风险/收益的基金。	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
下属分级基金的交易代码	005960	005961
报告期末下属分级基金的份额总额	25,404,457.13 份	403,890,977.96 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 10 月 1 日-2019 年 12 月 31 日)	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
1.本期已实现收益	-319,859.50	-1,917,880.36
2.本期利润	2,589,562.55	28,561,906.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.0648	0.0707
4.期末基金资产净值	27,339,265.76	429,398,047.94
5.期末基金份额净值	1.0762	1.0632

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。

#### 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. 博时量化价值股票A:

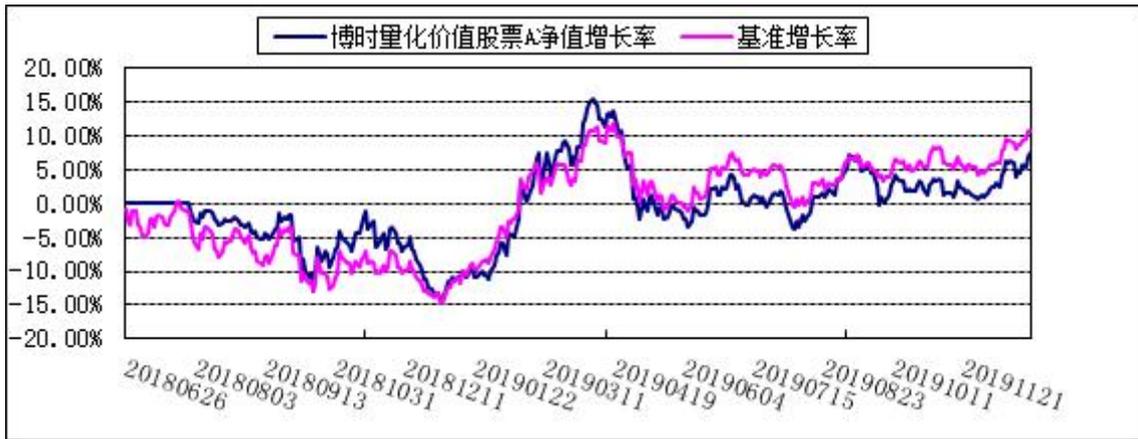
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	7.34%	0.76%	7.16%	0.64%	0.18%	0.12%

###### 2. 博时量化价值股票C:

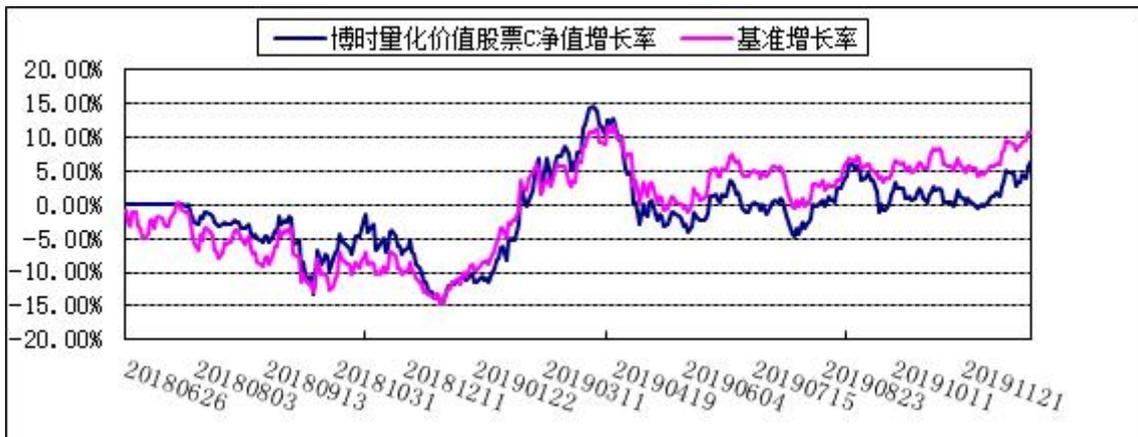
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	7.12%	0.76%	7.16%	0.64%	-0.04%	0.12%

##### 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. 博时量化价值股票A:



2. 博时量化价值股票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		
黄瑞庆	指数与量化投资部总经理/基金经理	2018-06-26	-	17.5	黄瑞庆先生，博士。2002年起先后在融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管理股份有限公司从事研究、投资、管理等工作。2013年加入博时基金管理有限公司。历任股票投资部ETF及量化组投资副总监、股票投资部ETF及量化组投资副总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监（主持工作）兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监、

					博时价值增长证券投资基金(2015年2月9日-2016年10月24日)、博时价值增长贰号证券投资基金(2015年2月9日-2016年10月24日)、博时特许价值混合型证券投资基金(2015年2月9日-2018年6月21日)的基金经理。现任指数与量化投资部总经理兼博时量化平衡混合型证券投资基金(2017年5月4日—至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018年4月3日—至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018年6月26日—至今)的基金经理。
林景艺	基金经理	2018-06-26	-	9.5	林景艺女士，硕士。2010年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任量化分析师、高级研究员兼基金经理助理。现任博时国企改革主题股票型证券投资基金(2015年5月20日—至今)、博时量化平衡混合型证券投资基金(2017年5月4日—至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018年4月3日—至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018年6月26日—至今)的基金经理。

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，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

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 52 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年四季度，市场整体波动加大。经历了 10 月和 11 月的反复盘整之后，12 月市场整体上涨，整个季度中证全指涨幅接近 7%。风格结构方面，市场也经历了较大的风格转换，10 月和 11 月大盘风格占优，12 月开始小盘风格占优，成长风格整体表现平稳，价值风格在前期走弱之后 12 月份也开始触底回升。行业板块方面，科技和消费板块内部分化，金融和周期板块整体表现较好，根据中信一级行业指数，建材、家电、电子元器件、传媒等行业指数涨幅靠前，国防军工、商贸零售、电力及公用事业、建筑、煤炭等行业涨幅靠后。

本基金是风格鲜明的运用量化方法进行价值型投资的产品。我们以自主研发的量化多策略体系为基础，从市场相对估值、历史相对估值和重要股东增持价格等多个方向衡量上市公司的估值高低，设计相应的量化策略选出具有估值优势的股票进行投资。当前，市场整体估值依然在历史相对低位，在这个估值基础上我们对于未来中长期的市场经不悲观，历史数据也验证了在市场底部区域布局低估值投资是一个非常可行的投资策略。未来我们将持续对价值型策略进行集中配置，在控制其他风格暴露的情况下突出组合的价值风格，获取长期超越市场的回报。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0762 元，份额累计净值为 1.0762 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0632 元，份额累计净值为 1.0632 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 7.34%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 7.12%，同期业绩基准增长率 7.16%。

### 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	权益投资	429,532,572.96	93.61
	其中：股票	429,532,572.96	93.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,290,080.00	0.72
	其中：债券	3,290,080.00	0.72
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	25,551,726.63	5.57
8	其他各项资产	463,455.37	0.10
9	合计	458,837,834.96	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	10,511,844.00	2.30
B	采矿业	23,223,739.00	5.08
C	制造业	165,351,302.13	36.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,512,255.54	0.99
E	建筑业	9,477,288.14	2.07
F	批发和零售业	9,394,413.00	2.06
G	交通运输、仓储和邮政业	3,980,689.00	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,814,903.85	3.68
J	金融业	127,368,929.36	27.89
K	房地产业	54,700,500.90	11.98
L	租赁和商务服务业	2,103,300.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	179,400.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	215,715.00	0.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,691,715.00	0.37
S	综合	-	-
	合计	429,532,572.96	94.04

## 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	601318	中国平安	174,400	14,904,224.00	3.26

2	601997	贵阳银行	1,345,400	12,862,024.00	2.82
3	600782	新钢股份	1,637,257	8,399,128.41	1.84
4	600015	华夏银行	1,009,900	7,745,933.00	1.70
5	600565	迪马股份	1,977,035	7,077,785.30	1.55
6	600746	江苏索普	979,100	7,059,311.00	1.55
7	600282	南钢股份	1,997,100	6,889,995.00	1.51
8	600466	蓝光发展	931,400	6,864,418.00	1.50
9	600340	华夏幸福	238,900	6,856,430.00	1.50
10	601328	交通银行	1,192,000	6,710,960.00	1.47

#### 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	2,801,680.00	0.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	488,400.00	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,290,080.00	0.72

#### 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	019611	19 国债 01	28,000	2,801,680.00	0.61
2	110065	淮矿转债	4,220	422,000.00	0.09
3	128089	麦米转债	664	66,400.00	0.01

#### 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投资。

#### 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中除华夏银行(600015)、交通银行(601328)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7月5日，因存在流动资金额度测算存在数据编造等违规行为，中国银行业监督管理委员会宁波监管局对华夏银行股份有限公司宁波分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。

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。

**5.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。**

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	348,457.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	68,301.39
5	应收申购款	46,696.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	463,455.37

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 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	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
本报告期期初基金份额总额	46,324,725.91	404,280,568.88
报告期基金总申购份额	490,858.72	101,645,404.88
减：报告期基金总赎回份额	21,411,127.50	102,034,995.80
报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	25,404,457.13	403,890,977.96
--------------	---------------	----------------

## §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	2019-10-01~2019-12-31	200,878,839.88	-	100,440,000.00	100,438,839.88	23.40%
	2	2019-12-19~2019-12-31	-	100,727,585.22	-	100,727,585.22	23.46%
	3	2019-10-01~2019-12-31	200,878,839.88	-	-	200,878,839.88	46.79%

#### 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 2019 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 199 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 10668 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 3270 亿元人民币，累计分红逾 1206 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 4 季末：

博时旗下权益类基金业绩表现优异，70 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）2019 年净值增长率超过 30%，38 只产品净值增长率超过 40%，10 只产品净值增长率超过 60%，4 只产品净值增长率超过 80%，2 只产品净值增长率超过 90%；从相对排名来看，62 只产品 2019 年净值增长率银河证券同类排名在前 1/2，32 只产品同类排名在前 1/4，13 只产品同类排名在前 10，2 只产品同类排名第 1。

其中，博时回报混合、博时医疗保健混合 2019 年净值增长率双双同类排名第 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) 同类排名第 2，博时文体娱乐主题混合、博时丝路主题股票(C 类)、博时乐臻定期开放混合、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(A 类)、博时弘盈定期开放混合(C 类)、博时特许价值混合(A 类)、博时中证银联智慧大数据 100 指数(C 类)、博时量化平衡混合、博时中证淘金大数据 100 指数(I 类)同类排名分别为第 4、第 4、第 7、第 7、第 7、第 8、第 8、第 10、第 10，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)、博时裕益灵活配置混合同类排名均在前 1/10，博时鑫源灵活配置混合(C 类)、博时厚泽回报灵活配置混合(C 类)、博时互联网主题灵活配置混合、博时新兴消费主题混合、博时沪港深优质企业灵活配置混合(C 类)、博时鑫泽灵活配置混合(A 类)、博时鑫源灵活配置混合(A 类)、博时创新驱动灵活配置混合(C 类)、博时颐泰混合(A 类)、博时新起点灵活配置混合(C 类)、博时新兴成长混合、博时颐泰混合(C 类)、博时新起点灵活配置混合(A 类)、博时厚泽回报灵活配置混合(A 类)、博时鑫瑞灵活配置混合(C 类)、博时战略新兴产业混合、博时睿远事件驱动灵活配置混合(LOF)、博时沪港深优质企业灵活配置混合(A 类)、博时策略灵活配置混合等产品 2019 年来净值增长率同类排名均在前 1/4。此外，博时裕隆灵活配置混合、博时主题行业混合(LOF)、博时汇智回报灵活配置混合、博时外延增长主题灵活配置混合、博时产业新动力灵活配置混合(A 类)等产品不仅 2019 年业绩表现较好，成立以来年化回报亦可观，长期投资价值凸显。

博时固定收益类基金表现同样可圈可点，67 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）2019 年净值增长率超过 4%，19 只产品净值增长率超过 6%，8 只产品净值增长率超过 10%，2 只产品净值增长率超过 30%；从相对排名来看，68 只产品 2019 年净值增长率银河证券同类排名在前 1/2，40 只产品同类排名在前 1/4，18 只产品同类排名在前 1/10，6 只产品同类排名前 5，1 只产品同类排名第 1。

其中，博时安康 18 个月定期开放债券(LOF)2019 年净值增长率同类排名第 1，博时安盈债券(A 类)、博时安盈债券(C 类)、博时月月薪定期支付债券、博时转债增强债券(C 类)、博时安心收益定期开放债券(C 类)同类排名分别在第 2、第 3、第 4、第 4、第 5，博时富瑞纯债债券(A 类)、博时转债增强债券(A 类)、博时信用债券(C 类)、博时安心收益定期开放债券(A 类)、博时裕顺纯

债债券、博时合惠货币(B类)、博时信用债券(A/B类)同类排名分别排在第6、第6、第7、第8、第9、第9、第9,博时裕腾纯债债券、博时裕泰纯债债券、博时岁岁增利一年定期开放债券、博时裕创纯债债券、博时裕盈纯债3个月定期开放债券发起式、博时富祥纯债债券、博时富兴纯债3个月定期开放债券发起式、博时信用债纯债债券(A类)、博时信用债纯债债券(C类)同类排名均在前1/10,博时稳健回报债券(LOF)(C类)、博时合惠货币(A类)、博时裕安纯债债券、博时稳健回报债券(LOF)(A类)、博时合鑫货币、博时聚瑞纯债6个月定期开放债券发起式、博时现金宝货币(B类)、博时现金宝货币(A类)、博时外服货币、博时富业纯债3个月定期开放债券发起式、博时安丰18个月定期开放债券(A类-LOF)、博时裕盛纯债债券、博时富腾纯债债券、博时天颐债券(A类)、博时宏观回报债券(A/B类)、博时安瑞18个月定期开放债券(A类)、博时天颐债券(C类)、博时安泰18个月定期开放债券(A类)、博时宏观回报债券(C类)、博时景兴纯债债券、博时裕达纯债债券等产品同类排名均在前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)2019 年净值增长率分别超过或接近 30%,同类排名分别为第 4、第 6、第 14;博时亚洲票息收益债券(人民币)2019 年净值增长率超过 10%,同类排名第 7。

商品型基金当中,博时黄金 ETF、博时黄金 ETF 联接(A类)、博时黄金 ETF 联接(C类)2019 年均较好地跟上了黄金上涨行情,净值增长率均超过 18%,其中博时黄金 ETF 净值增长率同类排名第 3。

## 2、其他大事件

2019 年 12 月 26 日,界面新闻在京举办“2019 中国优金融奖”颁奖盛典,博时基金凭借“政策响应、行业领先、实体支持、创新赋能”等方面的综合卓越表现,荣获“年度基金公司”大奖以及“2019 中国好品牌”。

2019 年 12 月 21 日,和讯网“第十七届财经风云榜金融峰会”在上海举办,博时基金荣获“年度卓越影响力基金公司”,博时基金葛晨获“年度卓越公募基金经理”。

2019 年 12 月 20 日,华夏时报“华夏机构投资者年会暨第十三届金蝉奖颁奖典礼”在北京举办。博时基金荣获“年度投研领先公募基金公司”。

2019 年 12 月 12 日,投资者网“2019 中国投资年度排名颁奖典礼”在上海隆重举行。博时基金荣获“年度值得信任卓越基金公司”。

2019 年 12 月 10 日,投资时报“见未来”——2019 第二届资本市场高峰论坛暨金禧奖年度颁奖盛典在京举办,博时基金荣获投资时报颁发的 2019 年度金禧奖“2019 最佳公募基金公司奖”。

2019 年 12 月 5 日,金融界“大变局·大视野·大未来”——第四届智能金融国际论坛暨 2019 金融界“领航中国”年度盛典在北京举行,博时基金斩获四项大奖,博时基金荣获“杰出年度基金公司奖”,凭借在金融科技方面的杰出贡献,获得“杰出年度智能金融品牌奖”,博时基金总经理江向阳荣获“杰出年度基金领袖奖”,博时基金王俊荣获“杰出年度基金经理奖”。

2019 年 12 月 5 日,21 世纪财经“金帆奖”颁奖典礼在广州举行,博时基金凭借在业内所取得的突出成就与贡献,获得“2019 年度基金管理公司金帆奖”。

2019 年 11 月 29 日,《经济观察报》在北京举办了“卓越金融企业”颁奖典礼,博时基金荣获“年度卓越综合实力基金公司”奖项。

2019 年 11 月 29 日,北京商报“寻路未来金融”——2019 年度北京金融论坛在京举办,博时基金凭借优秀的投研能力及全面的产品布局,荣获“北京金融业十大金融品牌——产品创新奖”。

2019 年 11 月 28 日,新浪财经 2019 新浪金麒麟论坛•ESG 峰会在北京举办,会上公布了 2019 中国企业 ESG“金责奖”评选名单,意在嘉奖那些对中国 ESG 事业做出卓越贡献的企业和机构,博时基金荣获 2019 中国企业 ESG 金责奖——“责任投资最佳基金公司奖”。

2019 年 11 月 22 日,2019 年度中国金融发展论坛暨金鼎奖颁奖典礼在北京举行,在资产管理领域甄选出了一批优质的标杆企业。群雄逐鹿百舸争流,博时基金跻身新资管时代的佼佼者,成功斩获“普惠金融奖”和“最佳海外固收产品奖”两项荣誉。

2019 年 11 月 15 日,中国经济网“2019 中国金融服务于创新论坛”在北京举办,博时基金荣获“金融服务 100 强”及“金融创新 100 强”称号。

2019 年 11 月 15 日,2019 年度第一财经金融价值榜(CFV)颁奖典礼在上海举行,博时基金凭借优秀的资产管理能力摘得“年度金融机构”奖项。

2019 年 11 月 9 日,人民日报社《国际金融报》和河南省商丘市人民政府共同主办的“第三届资本市场扶贫高峰论坛”在商丘市举办,博时基金荣获“年度扶贫企业奖”。

2019 年 10 月,由中国网主办的 2019 年度第二届“中国网之优秀金融扶贫先锋榜”评选活动圆满结束,经过多轮线上投票和业内专家、学者的专业评审,博时基金荣获 2019 年度第二届“中国网之优秀金融扶贫先锋榜”精准扶贫先锋机构奖项。

---

## §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量化价值股票型证券投资基金募集的文件
- 9.1.2 《博时量化价值股票型证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时量化价值股票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 博时量化价值股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 9.1.6 报告期内博时量化价值股票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

二〇二〇年一月十七日