

# 博时保证金实时交易型货币市场基金 更新招募说明书摘要

博时保证金实时交易型货币市场基金（以下简称“本基金”）的发行已获中国证监会证监许可[2014]935号文批准。自2014年11月17日至2014年11月19日通过销售机构公开发售。本基金为开放式，存续期间为不定期。本基金的基金合同于2014年11月25日正式生效。

## 【重要提示】

1、本基金根据2014年09月09日中国证券监督管理委员会《关于核准博时保证金实时交易型货币市场基金募集的批复》（证监许可[2014]935号）和2014年10月31日《关于博时保证金实时交易型货币市场基金募集时间安排的确认函》（证券基金机构监管部部函[2014]1674号）的准予注册，进行募集。

2、基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

3、本基金投资于货币市场，每百份基金净收益会因为货币市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而

形成的系统性风险，中央银行的利率调整和市场利率的波动构成本基金的利率风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险及本基金的特定风险等。本基金为货币市场基金，本基金属于低风险、低预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益均低于股票型基金、混合型基金及债券型基金。

本基金主要投资于货币市场工具，对流动性要求较高，这种确保高流动性的投资策略有可能造成投资收益的减少，另一方面，由于大额赎回被迫减仓的个券，若市场流动性弱，变现冲击成本较大，会造成变现损失，降低资产净值。例如，为满足投资者的赎回需要，基金可能保留大量的现金，而现金的投资收益最低，从而造成基金当期收益下降等风险。

4、本基金在上海证券交易所上市交易，对于选择买卖的投资人而言，交易费用和二级市场流动性等因素都会在一定程度上影响投资人的投资收益。如本基金销售机构未免除本基金的交易费用，则会降低投资人的投资收益；另外，二级市场的价格受供需关系的影响，可能高于或低于基金的份额净值，形成溢价交易或折价交易。当溢价交易时，买入份额的投资人以高于份额净值的价格买入本基金，投资收益可能减少，而卖出份额的投资人以高于份额净值的价格卖出本基金，投资收益有望增加；当折价交易时，买入份额的投资人以低于份额净值的价格买入本基金，投资收益有望增加，而卖出份额的投资人以低于面值的价格卖出本基金，投资收益可能减少。由于上海证券交易所可根据基金管理人的要求对本基金当日的赎回申请进行总量控制，所以投资人可能面临无法及时赎回本基金的风险。

5、正常情况下，本基金T日申购份额，T+2日可赎回或卖出；T日买入的基金份额当日可赎回或卖出。

6、投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》、基金产品资料概要及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，自主判断基金的投资价值，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策，自行承担投资风险。

7、基金的过往业绩并不预示其未来表现。

8、基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构。

9、基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况引致的投资风险，由投资人自行负责。

10、基金招募说明书自基金合同生效日起，每 6 个月更新一次，并于每 6 个月结束之日后的 45 日内公告，更新内容截至每 6 个月的最后 1 日。

11、本招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新的要求，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

12、本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2019 年 11 月 25 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 09 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 一、基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：博时基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层

法定代表人：张光华

成立时间：1998 年 7 月 13 日

注册资本：2.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：韩强

联系电话：（0755）8316 9999

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准设立。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份 49%；中国长城资产管理公司，持有股份 25%；天津港（集团）有限公司，持有股份 6%；上海汇华实业有限公司，持有股份 12%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份 6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份 2%。注册资本为 2.5 亿元人民币。

公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设两大总部和三十个直属部门，分别是：权益投资总部、固定收益总部以及宏观策略部、交易部、指数与量化投资部、多元资产管理部、年金投资部、绝对收益投资部、产品规划部、销售管理部、客户服务中心、市场部、养老金业务中心、战略客户部、机构-北京、机构-上海、机构-南方、券商业务部、零售-北京、零售-上海、零售-南方、零售-西部、

央企业务部、互联网金融部、董事会办公室、办公室、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、风险管理部和监察法律部。

权益投资总部负责公司所管理资产的权益投资管理及相关工作。权益投资总部下设股票投资部（含各投资风格小组）、特定资产管理部、研究部。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。特定资产管理部负责公司权益类特定资产专户和权益类社保投资组合的投资管理及相关工作。研究部负责完成对宏观经济、投资策略、行业上市公司及市场的研究。固定收益总部负责公司所管理资产的固定收益投资管理及相关工作。固定收益总部下设现金管理组、公募基金组、专户组、指数与创新组、国际组和研究组，分别负责各类固定收益资产的研究和投资工作。

市场部负责市场竞争分析、市场政策拟订；组织落实公司总体市场战略，协同产品和投资体系以及市场团队的协同；拟订年度市场计划和费用预算，具体负责机构业务的绩效考核和费用管理；公司品牌及产品传播；机构产品营销组织、市场分析等工作。战略客户部集中服务国有银行、政策性银行、大型头部保险公司、中央汇金公司等重要金融机构。机构-北京负责北方地区其他银行、保险和财务公司等机构业务。机构-上海和机构-南方分别主要负责华东地区、华南地区以及其他指定区域的机构客户销售与服务工作。养老金业务中心负责公司社保基金、企业年金、基本养老金及职业年金的客户拓展、销售与服务、养老金研究与政策咨询、养老金销售支持与中台运作协调、相关信息服务等工作。券商业务部负责券商渠道的开拓和销售服务、大宗交易业务、融券业务、做市商业务、股指期货业务等工作。零售-北京、零售-上海、零售-南方、零售-西部负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。央企业务部负责招商局集团签约机构客户、重要中央企业及其财务公司等客户的拓展、合作业务落地与服务等工作。销售管理部负责总行渠道维护，零售产品营销组织、销售督导；营销策划及公募销售支持；营销培训管理；渠道代销支持与服务；零售体系的绩效考核与费用管理等工作。

宏观策略部负责为投委会审定资产配置计划提供宏观研究和策略研究支持。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。指数与量化投资部负责公司各类指数与量化投资产品的研究和投资管理工作。多元资产管理部负责公司的基金中基金投资产品的研究和投资管理工作。年金投资部负责公司所管理企业年金等养老金资产的投资管理及相关工作。绝对收益投资部负责公司绝对收益产品的研究和投资管理工作。产品规划部负责新产品设计、新产品报批、主管部门沟通维护、产品维护以及年金方案设计、重要政府部门、监管部门以及交易所、外汇交易中心等证券市场重要主体的关系维护等工作。互联网金融部负

责公司互联网金融战略规划的设计和实施，公司互联网金融的平台建设、业务拓展和客户运营，推动公司相关业务在互联网平台的整合与创新。客户服务中心负责电话与网络咨询与服务；呼出业务与电话营销理财；营销系统数据维护与挖掘；直销柜台业务；专户合同及备案管理、机构售前支持；专户中台服务与运营支持等工作。

董事会办公室专门负责股东会、董事会、监事会及董事会各专业委员会各项会务工作；股东关系管理与董、监事的联络、沟通及服务；基金行业政策、公司治理、战略发展研究、公司文化建设；与公司治理及发展战略等相关的重大信息披露管理；政府公共关系管理；党务工作；博时慈善基金会的管理及运营等。办公室负责公司的行政后勤支持、会议及文件管理、外事活动管理、档案管理及工会工作等。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、员工沟通、人力资源信息管理工作。财务部负责公司预算管理、财务核算、成本控制、财务分析等工作。信息技术部负责信息系统开发、网络运行及维护、IT系统安全及数据备份等工作。基金运作部负责基金会计和基金注册登记等业务。风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察，并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。

另设北京分公司和上海分公司，分别负责对驻京、沪人员日常行政管理和对赴京、沪、处理公务人员给予协助。此外，还设有全资子公司博时资本管理有限公司，以及境外子公司博时基金（国际）有限公司。

截止到 2019 年 9 月 30 日，公司总人数为 593 人，其中研究员和基金经理超过 90%拥有硕士及以上学位。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

## 二、主要成员情况

### 1、基金管理人董事会成员

张光华先生，博士，董事长。历任国家外汇管理局政研室副主任，计划处处长，中国人民银行海南省分行副行长、党委委员，中国人民银行广州分行副行长、党委副书记，广东发展银行行长、党委副书记，招商银行副行长、执行董事、副董事长、党委副书记，在招商银行任职期间曾兼任永隆银行副董事长、招商基金管理有限公司董事长、招商信诺人寿保险有

限公司董事长、招银国际金融有限公司董事长、招银金融租赁有限公司董事长。2015年8月起，任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人。

江向阳先生，董事。2015年7月起任博时基金管理有限公司总经理。中共党员，南开大学国际金融博士，清华大学金融媒体EMBA。1986-1990年就读于北京师范大学信息与情报学系，获学士学位；1994-1997年就读于中国政法大学研究生院，获法学硕士学位；2003-2006年，就读于南开大学国际经济研究所，获国际金融博士学位。2015年1月至7月，任招商局金融集团副总经理、博时基金管理有限公司党委副书记。历任中国证监会办公厅、党办副主任兼新闻办（网信办）主任；中国证监会办公厅副巡视员；中国证监会深圳专员办处长、副专员；中国证监会期货监管部副处长、处长；中国农业工程研究设计院情报室干部。

苏敏女士，分别于1990年7月及2002年12月获得上海财经大学金融专业学士学位和中国科学技术大学工商管理硕士学位。苏女士分别于1998年6月、1999年6月及2008年6月获中国注册会计师协会授予的注册会计师资格、中国资产评估协会授予的注册资产评估师资格及安徽省人力资源和社会保障厅授予的高级会计师职称。苏女士拥有管理金融类公司及上市公司的经验，其经验包括：自2015年9月及2015年12月起任招商局金融集团有限公司总经理及董事；自2016年6月起任招商证券股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600999；香港联交所上市公司，股票代码：6099）董事；自2014年9月起担任招商银行股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600036；香港联交所上市公司，股票代码：3968）董事。自2016年1月至2018年8月任招商局资本投资有限责任公司监事；自2015年11月至2018年8月任招商局创新投资管理有限公司董事；自2015年11月至2017年4月任深圳招商启航互联网投资管理有限公司董事长；自2013年5月至2015年8月任中远海运能源运输股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600026；香港联交所上市公司，股票代码：1138）董事；自2013年6月至2015年12月任中远海运发展股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：601866；香港联交所上市公司，股票代码：2866）董事；自2009年12月至2011年5月担任徽商银行股份有限公司（香港联交所上市公司，股票代码：3698）董事；自2008年3月至2011年9月担任安徽省皖能股份有限公司（深圳证券交易所上市公司，股票代码：000543）董事。苏女士亦拥有会计等相关管理经验，其经验包括：自2011年3月至2015年8月担任中国海运（集团）总公司总会计师；自2007年5月至2011年4月担任安徽省能源集团有限公司总会计师，并于2010年11月至2011年4月担任该公司副总经理。2018年9月3日起，任博时基金管理有限公司第七届董事会董事。

王金宝先生，硕士，董事。1988年7月至1995年4月在上海同济大学数学系工作，任教师。1995年4月进入招商证券，先后任上海澳门路营业部总经理、上海地区总部副总经理（主持工作）、投资部总经理、投资部总经理兼固定收益部总经理、股票销售交易部总经理（现更名为机构业务总部）、机构业务董事总经理。2002年10月至2008年7月，任博时基金管理有限公司第二届、第三届监事会监事。2008年7月起，任博时基金管理有限公司第四届至第六届董事会董事。

陈克庆先生，北京大学工商管理硕士。2001年起历任世纪证券投资银行北京总部副总经理，国信证券投资业务部副总经理，华西证券投资银行总部副总经理、董事总经理。2014年加入中国长城资产管理公司，现任投资投行事业部副总经理。

方瓿华先生：硕士，中级经济师。2009年起，加入交通银行，历任交行上海分行市南支行、大客户二部、授信部、宝山支行行长助理等职位，主要负责营运及个人金融业务。2011年起，调入交通银行投资部，担任高级经理，负责交行对外战略投资及对下属子公司股权管理工作。2015年，加入上海信利股权投资基金管理有限公司并工作至今，历任高级投资经理、总经理、董事等职，同时兼任上海汇华实业有限公司总经理，负责公司整体运营。2018年9月起，担任上海盛业股权投资有限公司法定代表人及执行董事。2018年10月25日起，任博时基金管理有限公司第七届董事会董事。

顾立基先生，硕士，独立董事。1968年至1978年就职于上海印染机械修配厂，任共青团总支书记；1983年起，先后任招商局蛇口工业区管理委员会办公室秘书、主任；招商局蛇口工业区免税品有限公司董事总经理；中国国际海运集装箱股份有限公司董事副总经理、总经理；招商局蛇口工业区有限公司副总经理、国际招商局贸易投资有限公司董事副总经理；蛇口招商港务股份有限公司董事总经理；招商局蛇口工业区有限公司董事总经理；香港海通有限公司董事总经理；招商局科技集团有限公司董事总经理、招商局蛇口工业区有限公司副总经理。2008年退休。2008年2月至今，任清华大学深圳研究生院兼职教授；2008年11月至2010年10月，兼任招商局科技集团有限公司执行董事；2009年6月至今，兼任中国平安保险（集团）股份有限公司外部监事、监事会主席；2011年3月至今，兼任湘电集团有限公司外部董事；2013年5月至2014年8月，兼任德华安顾人寿保险有限公司（ECNL）董事；2013年6月至今，兼任深圳市昌红科技股份有限公司独立董事。2014年11月起，任博时基金管理有限公司第六届董事会独立董事。

姜立军先生，1955年生，会计师，工商管理硕士（MBA）。1974年12月参加工作，历任中国远洋运输总公司财务处科员、中国-坦桑尼亚联合海运服务公司财务部经理、日本中

铃海运服务公司财务部经理、中远(英国)公司财务部经理、香港益丰船务公司财务部经理、香港-佛罗伦租箱公司(香港上市公司)副总经理、中远太平洋有限公司(香港上市公司)副总经理、中远日本公司财务部长和营业副本部长、中远集装箱运输有限公司副总会计师等职。2002.8-2008.7,任中远航运股份有限公司(A股上市公司)首席执行官、董事。2008.8-2011.12,任中远投资(新加坡)有限公司(新加坡上市公司)总裁、董事会副主席、中远控股(新加坡)有限公司总裁;并任新加坡中资企业协会会长。2011.11-2015.12,任中国远洋控股股份有限公司执行(A+H上市公司)执行董事、总经理。2012.2-2015.12,兼任中国上市公司协会副监事长、天津上市公司协会副会长;2014.9-2015.12,兼任中国上市公司协会监事会专业委员会副主任委员。

赵如冰先生,1956年生,教授级高级工程师,国际金融专业经济学硕士研究生。历任葛洲坝水力发电厂工作助理工程师、工程师、高级工程师、葛洲坝二江电厂电气分厂主任、书记;1989.09—1991.10任葛洲坝至上海正负50万伏超高压直流输电换流站书记兼站长,主持参加了我国第一条亚洲最大的直流输电工程的安装调试和运行;1991.10—1995.12任厂办公室主任兼外事办公室主任;1995.12—1999.12,任华能南方开发公司党组书记、总经理,兼任中国华能集团董事、深圳南山热电股份有限公司(上市公司代码0037)副董事长、长城证券有限责任公司副董事长、深圳华能电讯有限公司董事长;2000.01-2004.07,华能南方公司被国家电力公司重组后,任华能房地产开发公司副总经理,长城证券有限责任公司副董事长、董事;2004.07-2009.03,任华能房地产开发公司党组书记、总经理;2009.12-2016.8,任景顺长城基金管理公司董事长、景顺长城资产管理(深圳)公司董事长;2016.8-至今,任阳光资产管理股份有限公司副董事长;兼任西南证券、百隆东方、威华股份独立董事。

## 2、基金管理人监事会成员

何敏女士,1975年出生,中南财经大学会计学硕士。1999年7月至2006年4月任招商证券股份有限公司财务部会计核算岗,2006年4月至2009年4月任招商证券股份有限公司财务部总经理助理,2009年4月至2019年2月任招商证券股份有限公司财务部副总经理,2019年2月至今任招商证券股份有限公司财务部总经理。2019年4月10日起,任博时基金管理有限公司监事会监事长。

陈良生先生,中央党校经济学硕士。1980年至2000年就职于中国农业银行巢湖市支行及安徽省分行。2000年起就职于中国长城资产管理公司,历任合肥办事处综合管理部部长、福州办事处党委委员、总经理、福建省分公司党委书记、总经理。2017年4月至今任中国



长城资产管理股份有限公司机构协同部专职董监事。2017年6月起任博时基金管理有限公司监事。

赵兴利先生，硕士，监事。1987年至1995年就职于天津港务局计财处。1995年至2012年5月先后任天津港贸易公司财务科科长、天津港货运公司会计主管、华夏人寿保险股份有限公司财务部总经理、天津港财务有限公司常务副总经理。2012年5月筹备天津港（集团）有限公司金融事业部，2011年11月至今任天津港（集团）有限公司金融事业部副部长。2013年3月起，任博时基金管理有限公司第五至六届监事会监事。

郑波先生，博士，监事。2001年起先后在中国平安保险公司总公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司公司董事总经理兼人力资源部总经理。2008年7月起，任博时基金管理有限公司第四至六届监事会监事。

黄健斌先生，工商管理硕士。1995年起先后在广发证券有限公司、广发基金管理有限责任公司投资管理部、中银国际基金管理有限公司基金管理部工作。2005年加入博时基金管理公司，历任固定收益部基金经理、博时平衡配置混合型证券投资基金基金经理、固定收益部副总经理、社保组合投资经理、固定收益部总经理、固定收益总部董事总经理、年金投资部总经理。现任公司总经理助理兼社保组合投资经理、高级投资经理、兼任博时资本管理有限公司董事。2016年3月18日至今担任博时基金管理有限公司监事会员工监事。

严斌先生，硕士，监事。1997年7月起先后在华侨城集团公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司财务部总经理。2015年5月起，任博时基金管理有限公司第六届监事会监事。

### 3、高级管理人员

张光华先生，简历同上。

江向阳先生，简历同上。

王德英先生，硕士，副总经理。1995年起先后在北京清华计算机公司任开发部经理、清华紫光股份公司CAD与信息事业部任总工程师。2000年加入博时基金管理有限公司，历任行政管理部副经理，电脑部副经理、信息技术部总经理、公司代总经理。现任公司副总经理兼首席信息官，主管IT、运作、指数与量化投资、养老金等工作，兼任博时基金（国际）有限公司及博时资本管理有限公司董事。

邵凯先生，经济学硕士，副总经理。1997年至1999年在河北省经济开发投资公司从事投资管理的工作。2000年8月加入博时基金管理有限公司，历任债券组合经理助理、债券组合经理、社保债券基金基金经理、固定收益部副总经理兼社保债券基金基金经理、固定收益

部总经理、固定收益投资总监、社保组合投资经理。现任公司副总经理、兼任博时基金（国际）有限公司董事、博时资本管理有限公司董事。

徐卫先生，硕士，副总经理。1993年起先后在深圳市证券管理办公室、中国证监会、摩根士丹利华鑫基金工作。2015年6月加入博时基金管理有限公司，现任公司副总经理兼博时资本管理有限公司董事、博时基金（国际）有限公司董事。

孙麒清女士，商法学硕士，督察长。曾供职于广东深港律师事务所。2002年加入博时基金管理有限公司，历任监察法律部法律顾问、监察法律部总经理。现任公司督察长，兼任博时基金（国际）有限公司董事、博时资本管理有限公司副董事长。

#### 4、本基金基金经理

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)、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-2019年8月19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。

本基金历任基金经理:张勇(2014 年 11 月 25 日-2015 年 6 月 8 日)、魏桢(2015 年 6 月 8 日-2017 年 4 月 26 日)。

#### 5、投资决策委员会成员

委员:江向阳、邵凯、黄健斌、李权胜、张龙、魏凤春、欧阳凡、王俊、过钧、黄瑞庆  
江向阳先生,简历同上。

邵凯先生,简历同上。

黄健斌先生,简历同上。

李权胜先生,硕士。1994 年至 1998 年在北京大学生命科学学院学习,获理学学士学位。1998 年至 2001 年继续就读于北京大学,获理学硕士学位。2013 年至 2015 年就读清华大学-香港中文大学金融 MBA 项目,获得香港中文大学 MBA 学位。2001 年 7 月至 2003 年 12 月在招商证券研发中心工作,任研究员;2003 年 12 月至 2006 年 2 月在银华基金工作,任基金经理助理。2006 年 3 月加入博时基金管理有限公司,任研究员。2007 年 3 月起任研究部研究员兼任博时精选股票基金经理助理。2008 年 2 月调任特定资产管理部投资经理。2012 年 8 月至 2014 年 12 月担任博时医疗保健行业股票型证券投资基金(2012.8.28-2014.12.26)基金经理。2016 年 7 月至 2018 年 1 月担任博时新趋势灵活配置混合型证券投资基金(2016.7.25-2018.1.5)基金经理。2013 年 12 月开始担任博时精选混合型证券投资基金(2013.12.19-至今)基金经理。现任公司董事总经理兼股票投资部总经理,权益投资价值组负责人,公司投资决策委员会成员。

张龙先生,硕士。1996 年起先后在长江证券、长盛基金、华夏基金、北京金百朋投资管理有限公司工作。2019 年加入博时基金管理有限公司,现任公司投资决策委员会专职委员。

魏凤春先生,博士。1993 年起先后在山东经济学院、江南信托、清华大学、江南证券、中信建投证券工作。2011 年加入博时基金管理有限公司。历任投资经理、博时抗通胀增强回报证券投资基金(2015 年 8 月 24 日-2016 年 12 月 19 日)、博时平衡配置混合型证券投资基金(2015 年 11 月 30 日-2016 年 12 月 19 日)的基金经理。现任首席宏观策略分析师兼宏观策略部总经理、多元资产管理部总经理、博时颐泽稳健养老目标一年持有期混合型基金中基

金（FOF）（2019年3月20日一至今）、博时颐泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（2019年8月28日-至今）的基金经理。

欧阳凡先生，硕士。2003年起先后在衡阳市金杯电缆厂、南方基金工作。2011年加入博时基金管理有限公司，曾任特定资产管理部副总经理、社保组合投资经理助理。现任公司董事总经理兼特定资产管理部总经理、权益投资 GARP 组负责人、年金投资部总经理、绝对收益投资部总经理、社保组合投资经理。

王俊先生，硕士。2008年从上海交通大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、金融地产与公用事业组组长、研究部副总经理、博时国企改革股票基金（2015.5.20-2016.6.8）、博时丝路主题股票基金（2015.5.22-2016.6.8）、博时沪港深价值优选混合基金（2017.1.25-2018.3.14）、博时沪港深成长企业混合基金（2016.11.9-2019.6.10）的基金经理。现任研究部总经理兼博时主题行业混合（LOF）基金（2015.1.22-至今）、博时沪港深优质企业混合基金（2016.11.9-至今）、博时新兴消费主题混合基金（2017.6.5-至今）、博时优势企业混合基金（2019.6.3-至今）的基金经理。

过钧先生，硕士。1995年起先后在上海工艺品进出口公司、德国德累斯顿银行上海分行、美国 Lowes 食品有限公司、美国通用电气公司、华夏基金固定收益部工作。2005年加入博时基金管理有限公司，历任基金经理、博时稳定价值债券投资基金（2005.8.24-2010.8.4）的基金经理、固定收益部副总经理、博时转债增强债券型证券投资基金（2010.11.24-2013.9.25）、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金（2013.2.1-2014.4.2）、博时裕祥分级债券型证券投资基金（2014.1.8-2014.6.10）、博时双债增强债券型证券投资基金（2013.9.13-2015.7.16）、博时新财富混合型证券投资基金（2015.6.24-2016.7.4）、博时新机遇混合型证券投资基金（2016.3.29-2018.2.6）、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金（2016.8.1-2018.2.6）、博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）（2014.6.10-2018.4.23）、博时双债增强债券型证券投资基金（2016.10.24-2018.5.5）、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金（2017.2.10-2018.5.21）、博时鑫和灵活配置混合型证券投资基金（2017.12.13-2018.6.16）、博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金（2017.1.10-2018.7.30）的基金经理、固定收益总部公募基金组负责人、博时新价值灵活配置混合型证券投资基金（2016.3.29-2019.4.30）、博时乐臻定期开放混合型证券投资基金（2016.9.29-2019.10.14）的基金经理。现任公司董事总经理兼固定收益总部指数与创新组负责人、博时信用债券投资基金（2009.6.10-至今）、博时新收益灵活配置混合型证券投资基金（2016.2.29-至今）、博时鑫源灵活配置混合型证券投资基金（2016.9.6-至今）、

博时乐臻定期开放混合型证券投资基金（2016.9.29-至今）、博时新起点灵活配置混合型证券投资基金（2016.10.17-至今）、博时鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金（2017.2.10-至今）、博时中债3-5年进出口行债券指数证券投资基金（2018.12.25-至今）、博时转债增强债券型证券投资基金（2019.1.28-至今）、博时中债3-5年国开行债券指数证券投资基金（2019.7.19-至今）的基金经理。

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、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）、股票投资部量化投资组投资总监、博时价值增长混合基金（2015.2.9-2016.10.24）、博时价值增长贰号混合基金（2015.2.9-2016.10.24）、博时特许价值混合基金（2015.2.9-2018.6.21）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基金（2017.5.4-至今）、博时量化多策略股票基金（2018.4.3-至今）、博时量化价值股票基金（2018.6.26-至今）的基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2018年末，集团资产规模23.22万亿元，较上年增长4.96%。2018年度，集团实现净利润2,556.26亿元，较上年增长4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为1.13%和14.04%；不良贷款率1.46%，保持稳中有降；资本充足率17.19%，保持领先同业。

2018年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018年中国最佳大型零售银行奖”、“2018年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018年金龙奖—年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会2018年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等11个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工300余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原珩，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2019年二季度末，中国建设银行已托管924只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

## 三、相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、申购赎回代理券商（简称“一级交易商”）

##### （1）国泰君安证券股份有限公司

|         |                          |
|---------|--------------------------|
| 注册地址：   | 中国（上海）自由贸易试验区商城路618号     |
| 办公地址：   | 上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼 |
| 法定代表人：  | 杨德红                      |
| 联系人：    | 芮敏祺                      |
| 电话：     | 021-38676666             |
| 传真：     | 021-38670161             |
| 客户服务电话： | 95521                    |
| 网址：     | www.gtja.com             |

##### （2）中信建投证券股份有限公司

|        |                 |
|--------|-----------------|
| 注册地址：  | 北京市朝阳区安立路66号4号楼 |
| 办公地址：  | 北京市朝阳区门内大街188号  |
| 法定代表人： | 王常青             |
| 联系人：   | 刘畅              |

|         |   |
|---------|---|
| 电话:     | 010-65608231  |
| 传真:     | 010-65182261  |
| 客户服务电话: | 400888108/95587   |
| 网址:     | <a href="http://www.csc108.com/">http://www.csc108.com/</a> |

**(3) 国信证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层                                   |
| 办公地址:   | 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层                                   |
| 法定代表人:  | 何如  |
| 联系人:    | 李颖  |
| 电话:     | 0755-82130833   |
| 传真:     | 0755-82133952   |
| 客户服务电话: | 95536   |
| 网址:     | <a href="http://www.guosen.com.cn/">http://www.guosen.com.cn/</a> |

**(4) 招商证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号  |
| 办公地址:   | 深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼                                       |
| 法定代表人:  | 霍达  |
| 联系人:    | 黄婵君   |
| 电话:     | 0755-82943666   |
| 传真:     | 0755-83734343   |
| 客户服务电话: | 4008881111; 95565   |
| 网址:     | <a href="http://www.newone.com.cn/">http://www.newone.com.cn/</a> |

**(5) 广发证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼 (4301-4316 房)               |
| 办公地址:   | 广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦                                      |
| 法定代表人:  | 孙树明   |
| 联系人:    | 黄岚  |
| 电话:     | 020-87555888  |
| 传真:     | 020-87555305  |
| 客户服务电话: | 95575 或 020-95575   |
| 网址:     | <a href="http://www.gf.com.cn/">http://www.gf.com.cn/</a> |

**(6) 中信证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场 (二期) 北座                                   |
| 办公地址:   | 北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦   |
| 法定代表人:  | 张佑君   |
| 联系人:    | 马静懿   |
| 电话:     | 010-60833889  |
| 传真:     | 010-84865560  |
| 客户服务电话: | 400-889-5548/95548  |
| 网址:     | <a href="http://www.cs.ecitic.com/">http://www.cs.ecitic.com/</a> |



**(7) 中国银河证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座   |
| 办公地址:   | 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2—6 层   |
| 法定代表人:  | 陈共炎   |
| 联系人:    | 辛国政   |
| 电话:     | 010-83574507  |
| 传真:     | 010-66568990  |
| 客户服务电话: | 95551/4008888888  |
| 网址:     | <a href="http://www.chinastock.com.cn/">http://www.chinastock.com.cn/</a> |

**(8) 海通证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 上海市淮海中路 98 号  |
| 办公地址:   | 上海市广东路 689 号海通证券大厦  |
| 法定代表人:  | 周杰  |
| 联系人:    | 李笑鸣   |
| 电话:     | 021-23219275  |
| 传真:     | 021-63602722  |
| 客户服务电话: | 95553   |
| 网址:     | <a href="http://www.htsec.com/">http://www.htsec.com/</a> |

**(9) 申万宏源证券有限公司**

|         |  |
|---------|--|
| 注册地址:   | 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层                               |
| 办公地址:   | 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层                               |
| 法定代表人:  | 李梅   |
| 联系人:    | 余敏   |
| 电话:     | 021-33388252                                       |
| 传真:     | 021-33388224                                       |
| 客户服务电话: | 95523 或 4008895523                                 |
| 网址:     | <a href="http://www.swhysc.com">www.swhysc.com</a> |

**(10) 兴业证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 福州市湖东路 268 号  |
| 办公地址:   | 上海市浦东民生路 1199 弄五道口广场 1 号楼 21 层                                |
| 法定代表人:  | 杨华辉   |
| 联系人:    | 乔琳雪   |
| 电话:     | 021-38565547  |
| 传真:     | 021-38565783  |
| 客户服务电话: | 4008888123/95562  |
| 网址:     | <a href="http://www.xyzq.com.cn/">http://www.xyzq.com.cn/</a> |

**(11) 安信证券股份有限公司**

|        |                                       |
|--------|---------------------------------------|
| 注册地址:  | 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 |
| 办公地址:  | 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 |
| 法定代表人: | 王连志                                   |

|         |   |
|---------|---|
| 联系人:    | 刘志斌   |
| 电话:     | 0755-82558323   |
| 传真:     | 0755-82558355   |
| 客户服务电话: | 95517, 4008001001   |
| 网址:     | <a href="http://www.essence.com.cn">http://www.essence.com.cn</a> |

**(12) 万联证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层                   |
| 办公地址:   | 广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层                   |
| 法定代表人:  | 张建军   |
| 联系人:    | 王鑫  |
| 电话:     | 020-38286686  |
| 传真:     | 020-22373718-1013                                   |
| 客户服务电话: | 4008888133  |
| 网址:     | <a href="http://www.wlzq.cn">http://www.wlzq.cn</a> |

**(13) 渤海证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室                          |
| 办公地址:   | 天津市南开区宾水西道 8 号  |
| 法定代表人:  | 王春峰   |
| 联系人:    | 胡天彤   |
| 电话:     | 022-28451861  |
| 传真:     | 022-28451892  |
| 客户服务电话: | 4006515988  |
| 网址:     | <a href="http://www.bhzq.com">http://www.bhzq.com</a> |

**(14) 华泰证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 南京市江东中路 228 号   |
| 办公地址:   | 办公地址 南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼       |
| 法定代表人:  | 周易  |
| 联系人:    | 胡子豪   |
| 电话:     | 021-50531281  |
| 传真:     | 0755-82492962 (深圳)  |
| 客户服务电话: | 95597   |
| 网址:     | <a href="http://www.htsc.com.cn/">http://www.htsc.com.cn/</a> |

**(15) 中信证券(山东)有限责任公司**

|         |                                   |
|---------|-----------------------------------|
| 注册地址:   | 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层 |
| 办公地址:   | 青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东 2、5 层        |
| 法定代表人:  | 姜晓林                               |
| 联系人:    | 孙秋月                               |
| 电话:     | 0532-85022026                     |
| 传真:     | 0532-85022605                     |
| 客户服务电话: | 95548                             |

|     |   |
|-----|---|
| 网址: | <a href="http://www.zxzqsd.com.cn/">http://www.zxzqsd.com.cn/</a> |
|-----|---|

**(16) 东吴证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 江苏省苏州市翠园路 181 号   |
| 办公地址:   | 江苏省苏州市星阳街 5 号   |
| 法定代表人:  | 吴永敏   |
| 联系人:    | 方晓丹   |
| 电话:     | 0512-65581136   |
| 传真:     | 0512-65588021   |
| 客户服务电话: | 4008601555  |
| 网址:     | <a href="http://www.dwjq.com.cn">http://www.dwjq.com.cn</a> |

**(17) 信达证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼                                       |
| 办公地址:   | 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼                                       |
| 法定代表人:  | 张志刚   |
| 联系人:    | 尹旭航   |
| 电话:     | 010-63081493  |
| 传真:     | 010-63081344  |
| 客户服务电话: | 95321   |
| 网址:     | <a href="http://www.cindasc.com">http://www.cindasc.com</a> |

**(18) 方正证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层                                      |
| 办公地址:   | 湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层                                      |
| 法定代表人:  | 施华  |
| 联系人:    | 程博怡   |
| 电话:     | 010-56437060  |
| 传真:     | 0731-85832214   |
| 客户服务电话: | 95571   |
| 网址:     | <a href="http://www.foundersc.com">http://www.foundersc.com</a> |

**(19) 长城证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层                          |
| 办公地址:   | 深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层                       |
| 法定代表人:  | 丁益  |
| 联系人:    | 沈晓  |
| 电话:     | 0755-83464734   |
| 传真:     | 0755-83515567   |
| 客户服务电话: | 4006666888  |
| 网址:     | <a href="http://www.cgws.com">http://www.cgws.com</a> |

**(20) 光大证券股份有限公司**

|       |                  |
|-------|------------------|
| 注册地址: | 上海市静安区新闻路 1508 号 |
| 办公地址: | 上海市静安区新闻路 1508 号 |

|         |   |
|---------|---|
| 法定代表人:  | 周健男   |
| 联系人:    | 李芳芳   |
| 电话:     | 021-22169089  |
| 传真:     | 021-22169134  |
| 客户服务电话: | 4008888788; 95525   |
| 网址:     | <a href="http://www.ebscn.com/">http://www.ebscn.com/</a> |

**(21) 广州证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层                             |
| 办公地址:   | 广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层                             |
| 法定代表人:  | 邱三发   |
| 联系人:    | 林洁茹   |
| 电话:     | 020-88836999  |
| 传真:     | 020-88836654  |
| 客户服务电话: | 95396   |
| 网址:     | <a href="http://www.gzs.com.cn">http://www.gzs.com.cn</a> |

**(22) 东北证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 长春市生态大街6666号  |
| 办公地址:   | 长春市生态大街6666号  |
| 法定代表人:  | 李福春   |
| 联系人:    | 安岩岩   |
| 电话:     | 0431-85096517                                       |
| 传真:     | 0431-85096795                                       |
| 客户服务电话: | 95360   |
| 网址:     | <a href="http://www.nesc.cn">http://www.nesc.cn</a> |

**(23) 上海证券有限责任公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 上海市黄浦区四川中路213号7楼  |
| 办公地址:   | 上海市黄浦区四川中路213号7楼  |
| 法定代表人:  | 李俊杰   |
| 联系人:    | 邵珍珍   |
| 电话:     | 021-53686262  |
| 传真:     | 021-63608830  |
| 客户服务电话: | 4008918918、021-962518                                     |
| 网址:     | <a href="https://www.shzq.com/">https://www.shzq.com/</a> |

**(24) 新时代证券股份有限公司**

|         |                           |
|---------|---------------------------|
| 注册地址:   | 北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501 |
| 办公地址:   | 北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501 |
| 法定代表人:  | 叶顺德                       |
| 联系人:    | 田芳芳                       |
| 电话:     | 010-83561000              |
| 传真:     | 010-83561001              |
| 客户服务电话: | 95399                     |

|     |   |
|-----|---|
| 网址: | <a href="http://www.xsdzq.cn">http://www.xsdzq.cn</a> |
|-----|---|

**(25) 平安证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 广东省深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层                                    |
| 办公地址:   | 广东省深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层                                    |
| 法定代表人:  | 何之江   |
| 联系人:    | 周一涵   |
| 电话:     | 021-38637436  |
| 传真:     | 0755-82400862   |
| 客户服务电话: | 0755-22628888/95511-8   |
| 网址:     | <a href="http://www.stock.pingan.com">http://www.stock.pingan.com</a> |

**(26) 华安证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号                                  |
| 办公地址:   | 安徽省合肥市南二环 959 号财智中心 B1 座                                |
| 法定代表人:  | 章宏韬   |
| 联系人:    | 范超  |
| 电话:     | 0551-65161821   |
| 传真:     | 0551-65161672   |
| 客户服务电话: | 0551-96518/4008096518/95318                             |
| 网址:     | <a href="http://www.hazq.com/">http://www.hazq.com/</a> |

**(27) 国海证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 广西桂林市辅星路 13 号   |
| 办公地址:   | 深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦 3 楼                                       |
| 法定代表人:  | 张雅锋   |
| 联系人:    | 武斌  |
| 电话:     | 0755-83707413   |
| 传真:     | 0755-83700205   |
| 客户服务电话: | 4008888100 (全国), 96100 (广西)                                 |
| 网址:     | <a href="http://www.ghzq.com.cn">http://www.ghzq.com.cn</a> |

**(28) 国都证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层                         |
| 办公地址:   | 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层                         |
| 联系人:    | 杜正中   |
| 电话:     | 010-84183142  |
| 传真:     | 010-84183311-3389                                       |
| 客户服务电话: | 400-818-8118  |
| 网址:     | <a href="http://www.guodu.com">http://www.guodu.com</a> |

**(29) 中银国际证券股份有限公司**

|        |                              |
|--------|------------------------------|
| 注册地址:  | 中国上海浦东银城中路 200 号中银大厦 39-40 层 |
| 办公地址:  | 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层   |
| 法定代表人: | 宁敏                           |

|         |   |
|---------|---|
| 联系人:    | 许慧琳   |
| 电话:     | 021-20328531  |
| 传真:     | 021-50372474  |
| 客户服务电话: | 4006208888; 021-61195566  |
| 网址:     | <a href="http://www.bocichina.com">http://www.bocichina.com</a> |

**(30) 恒泰证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 楼                       |
| 办公地址:   | 内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 楼                       |
| 法定代表人:  | 庞介民   |
| 联系人:    | 熊丽  |
| 电话:     | 0471-4972675  |
| 传真:     | 0471-4930707  |
| 客户服务电话: | 400-196-6188  |
| 网址:     | <a href="http://www.cnht.com.cn/">http://www.cnht.com.cn/</a> |

**(31) 国盛证券有限责任公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 江西省南昌市永叔路 15 号  |
| 办公地址:   | 江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行大厦                             |
| 法定代表人:  | 徐丽峰   |
| 联系人:    | 占文驰   |
| 电话:     | 0791-86283372   |
| 传真:     | 0791-6289395  |
| 客户服务电话: | 4008222111  |
| 网址:     | <a href="https://www.gszq.com/">https://www.gszq.com/</a> |

**(32) 华西证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦                                     |
| 办公地址:   | 四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦                                     |
| 法定代表人:  | 杨炯洋   |
| 联系人:    | 谢国梅   |
| 电话:     | 010-58124967  |
| 传真:     | 028-86150040  |
| 客户服务电话: | 95584   |
| 网址:     | <a href="http://www.hx168.com.cn">http://www.hx168.com.cn</a> |

**(33) 中泰证券股份有限公司**

|        |                     |
|--------|---------------------|
| 注册地址:  | 山东省济南市经十路 20518 号   |
| 办公地址:  | 山东省济南市经七路 86 号 23 层 |
| 法定代表人: | 李玮                  |
| 联系人:   | 朱琴                  |
| 电话:    | 021-20315161        |
| 传真:    | 0531-68889357       |

|         |                |
|---------|----------------|
| 客户服务电话: | 95538          |
| 网址:     | www.zts.com.cn |

**(34) 第一创业证券股份有限公司**

|         |                                 |
|---------|---------------------------------|
| 注册地址:   | 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼       |
| 办公地址:   | 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼       |
| 法定代表人:  | 刘学民                             |
| 联系人:    | 王叔胤                             |
| 电话:     | 0755-23838776                   |
| 传真:     | 0755-25838701                   |
| 客户服务电话: | 95358                           |
| 网址:     | http://www.firstcapital.com.cn/ |

**(35) 德邦证券股份有限公司**

|         |                             |
|---------|-----------------------------|
| 注册地址:   | 上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼      |
| 办公地址:   | 上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 26 楼 |
| 法定代表人:  | 武晓春                         |
| 联系人:    | 刘熠                          |
| 电话:     | 021-68761616                |
| 传真:     | 021-68767981                |
| 客户服务电话: | 4008888128                  |
| 网址:     | http://www.tebon.com.cn     |

**(36) 华龙证券股份有限公司**

|         |                                    |
|---------|------------------------------------|
| 注册地址:   | 甘肃省兰州市静宁路 308 号                    |
| 办公地址:   | 甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦            |
| 法定代表人:  | 李晓安                                |
| 联系人:    | 范坤/杨力                              |
| 电话:     | 0931-4890208, 18993185278(范) /189  |
| 传真:     | 0931-4890628                       |
| 客户服务电话: | 95368/0931-4890619 4890618 4890100 |
| 网址:     | http://www.hlzqgs.com/             |

**(37) 财通证券股份有限公司**

|         |                            |
|---------|----------------------------|
| 注册地址:   | 杭州市解放路 111 号               |
| 办公地址:   | 杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 1602 室 |
| 法定代表人:  | 陆建强                        |
| 联系人:    | 陶志华                        |
| 电话:     | 0571-87789160              |
| 传真:     | 0571-87925100              |
| 客户服务电话: | 95336 (上海地区 962336)        |
| 网址:     | http://www.ctsec.com       |

**(38) 瑞银证券有限责任公司**

|       |                                  |
|-------|----------------------------------|
| 注册地址: | 北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层 |
|-------|----------------------------------|

|         |   |
|---------|---|
| 办公地址:   | 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层   |
| 法定代表人:  | 程宜荪   |
| 联系人:    | 牟冲  |
| 电话:     | 010-5832 8112   |
| 传真:     | 010-5832 8748   |
| 客户服务电话: | 4008878827  |
| 网址:     | <a href="http://www.ubssecurities.com">http://www.ubssecurities.com</a> |

**(39) 中国中金财富证券有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元 |
| 办公地址:   | 深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层   |
| 法定代表人:  | 高涛  |
| 联系人:    | 万玉琳   |
| 电话:     | 0755-82026907   |
| 传真:     | 0755-82026539   |
| 客户服务电话: | 4006008008/95532  |
| 网址:     | <a href="http://www.china-invs.cn/">http://www.china-invs.cn/</a>                   |

**(40) 西藏东方财富证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼                           |
| 办公地址:   | 上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦                           |
| 法定代表人:  | 陈宏  |
| 联系人:    | 付佳  |
| 电话:     | 021-23586603                                    |
| 传真:     | 021-23586860                                    |
| 客户服务电话: | 95357   |
| 网址:     | <a href="http://www.18.cn">http://www.18.cn</a> |

**(41) 华宝证券有限责任公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼                                      |
| 办公地址:   | 上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼                                      |
| 法定代表人:  | 陈林  |
| 联系人:    | 刘闻川   |
| 电话:     | 021-68777222  |
| 传真:     | 021-68777822  |
| 客户服务电话: | 4008209898;021-38929908   |
| 网址:     | <a href="http://www.cnhbstock.com">http://www.cnhbstock.com</a> |

**(42) 财达证券有限责任公司**

|        |                              |
|--------|------------------------------|
| 注册地址:  | 河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层 |
| 办公地址:  | 河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层 |
| 法定代表人: | 翟建强                          |



|         |   |
|---------|---|
| 联系人:    | 刘亚静   |
| 电话:     | 0311-66006393   |
| 传真:     | 0311-66006249   |
| 客户服务电话: | 4006128888  |
| 网址:     | <a href="http://www.S10000.com">http://www.S10000.com</a> |

**(43) 天风证券股份有限公司**

|         |   |
|---------|---|
| 注册地址:   | 湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼                          |
| 法定代表人:  | 余磊  |
| 联系人:    | 程晓英   |
| 电话:     | 027-87107535  |
| 客户服务电话: | 400-800-5000/ 95391                                     |
| 网址:     | <a href="http://www.tfzq.com/">http://www.tfzq.com/</a> |

**2、二级市场交易代理券商**

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

3、基金管理人可根据有关法律法规，变更、增减发售本基金的销售机构，并及时公告。

**二、登记机构**

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系电话：（010）59378888

传真：（010）59378907

联系人：朱立元

**三、出具法律意见书的律师事务所**

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

经办律师：安冬、孙睿

#### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：沈兆杰

经办注册会计师：张振波、沈兆杰

#### 四、基金的名称

博时保证金实时交易型货币市场基金

#### 五、基金的类型

货币市场型基金。

#### 六、基金运作方式

本基金运作方式为开放式，存续期间为不定期。

#### 七、基金的投资目标

在保持相对低风险和相对高流动性的前提下获得高于业绩比较基准的回报。

#### 八、投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会及/或中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 九、投资策略

本基金在资产配置时应充分考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征。在风险与收益的配比中，力求降低各类风险，并争取在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。

### （一）资产配置策略

本基金将深入研究宏观经济状况、政策变化趋势、市场资金供求状况等，通过自上而下和自下而上相结合，充分运用收益率策略与估值策略相结合的方法，对各类可投资资产进行合理的配置和选择，同时控制组合内资产的平均剩余期限在 120 天以内。

### （二）利率策略

在宏观分析与流动性分析的基础上，结合历史与经验数据，通过定性分析与定量分析相结合的方法，判断当前资金的时间价值、通货膨胀补偿、流动性溢价、收益率曲线等，进而对短期利率的变化态势做出及时反应，并据此动态调整投资组合。

### （三）回购配置策略

在长期、中期和短期回购资产类属配置层上，强调通过对中长期回购利率波动规律的把握对回购资产进行时间方向上的动态配置策略。同时根据回购利差进行回购品种的配置比例调整。

### （四）个券选择策略

在短期债券的个券选择上利用收益率利差策略、收益率曲线策略以及含权债券价值变动策略选择收益高或价值低估的短期债券，进行投资决策。

### （五）银行定期存款投资策略

银行定期存款的投资将是本基金关注的目标之一。具体而言，在组合投资过程中，本基金将在综合考虑成本收益的基础上，根据不同银行的银行存款收益率情况，结合银行的信用等级、存款期限等因素的分析，以及对整体利率市场环境及其变动趋势的研究，在严格控制风险的前提下选择具有较高投资价值的银行存款进行投资。并且尽可能的扩大交易对手方的覆盖范围，挖掘出利率报价较高的多家银行进行银行定期存款的投资，在获取较高投资收益的同时尽量分散投资风险，提高存款及存单资产的流动性。

#### （六）流动性管理策略

本基金将综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例,通过现金留存、控制同业存款的比例、持有高流动性券种、正向回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性。并且,在日常投资管理中,本基金将会紧密关注申赎现金流变化情况、季节性资金流动等影响货币市场基金流动性管理的因素。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

## 十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准拟为:七天通知存款税后利率

本基金定位为现金管理工具,根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金采用七天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场出现更加适合用于本基金的业绩比较基准,在与基金托管人协商一致后,本基金管理人可以在报中国证监会备案后调整或变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

## 十一、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较低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

## 十二、基金投资组合报告

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定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。

本投资组合报告所载数据截至 2019 年 09 月 30 日,本报告中所列财务数据未经审计。

### 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            | 129,569,149.22 | 41.84        |
|    | 其中：债券             | 129,569,149.22 | 41.84        |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 买入返售金融资产          | 108,540,682.81 | 35.05        |
|    | 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      | 70,296,235.86  | 22.70        |
| 5  | 其他各项资产            | 1,248,054.55   | 0.40         |
| 6  | 合计                | 309,654,122.44 | 100.00       |

## 2 报告期债券回购融资情况

| 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 | 1.21          |               |
|    | 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 | -             | -             |
|    | 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

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

## 3 基金投资组合平均剩余期限

### 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    | 42 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 50 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 28 |

### 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。

### 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  | 43.71              | -                  |

|    |                      |        |   |
|----|----------------------|--------|---|
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | - |
| 2  | 30天(含)—60天           | 16.31  | - |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | - |
| 3  | 60天(含)—90天           | 40.71  | - |
|    | 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 |                      | 100.73 | - |

## 4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限没有超过 240 天的情况。

## 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                 | 摊余成本(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------------------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券                 | -              | -            |
| 2  | 央行票据                 | -              | -            |
| 3  | 金融债券                 | 40,012,587.07  | 13.07        |
|    | 其中：政策性金融债            | 40,012,587.07  | 13.07        |
| 4  | 企业债券                 | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券              | -              | -            |
| 6  | 中期票据                 | -              | -            |
| 7  | 同业存单                 | 89,556,562.15  | 29.25        |
| 8  | 其他                   | -              | -            |
| 9  | 合计                   | 129,569,149.22 | 42.32        |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -              | -            |

## 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<br>(张) | 摊余成本(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|-------------|---------------|--------------|
| 1  | 111812223 | 18 北京银行 CD223 | 300,000     | 29,854,066.68 | 9.75         |
| 2  | 111987608 | 19 南京银行 CD067 | 300,000     | 29,840,926.88 | 9.75         |
| 3  | 180410    | 18 农发 10      | 200,000     | 20,008,349.92 | 6.53         |
| 4  | 160215    | 16 国开 15      | 200,000     | 20,004,237.15 | 6.53         |
| 5  | 111916252 | 19 上海银行 CD252 | 200,000     | 19,914,799.80 | 6.50         |
| 6  | 111812226 | 18 北京银行 CD226 | 100,000     | 9,946,768.79  | 3.25         |

## 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                   | 0.0514%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0045% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0133%  |

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%。

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  
无。

## 9 投资组合报告附注

## 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 100.00 元。

9.2 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除 18 北京银行 CD223(111812223)、18 北京银行 CD226(111812226)、19 南京银行 CD067(111987608)、19 上海银行 CD252(111916252)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 6 月 4 日，因存在员工行为管理不审慎等违规行为，中国银行保险监督管理委员会浙江监管局对南京银行杭州分行处以罚款的行政处罚。

2019 年 8 月 21 日，因存在办理某黄金租赁业务时，授信管理严重不审慎等违规行为，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海银行股份有限公司市北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。

### 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    | 1,248,054.55 |
| 4  | 应收申购款   | -            |
| 5  | 其他应收款   | -            |
| 6  | 待摊费用    | -            |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 1,248,054.55 |

### 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。

## 十三、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

自基金合同生效开始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：

| 期间                    | ①净值收<br>益率 | ②净值<br>收益率<br>标准差 | ③业绩<br>比较基<br>准收益<br>率 | ④业绩比<br>较基准收<br>益率标准<br>差 | ①-③     | ②-④     |
|-----------------------|------------|-------------------|------------------------|---------------------------|---------|---------|
| 2014.11.25-2014.12.31 | 0.4010%    | 0.0066%           | 0.1368%                | 0.0000%                   | 0.2642% | 0.0066% |
| 2015.01.01-2015.12.31 | 2.9087%    | 0.0082%           | 1.3500%                | 0.0000%                   | 1.5587% | 0.0082% |
| 2016.01.01-2016.12.31 | 2.3753%    | 0.0015%           | 1.3500%                | 0.0000%                   | 1.0253% | 0.0015% |
| 2017.01.01-2017.12.31 | 3.4060%    | 0.0017%           | 1.3500%                | 0.0000%                   | 2.0560% | 0.0017% |
| 2018.01.01-2018.12.31 | 3.1411%    | 0.0019%           | 1.3500%                | 0.0000%                   | 1.7911% | 0.0019% |
| 2019.01.01-2019.09.30 | 1.6203%    | 0.0005%           | 1.0097%                | 0.0000%                   | 0.6106% | 0.0005% |
| 2014.11.25-2019.09.30 | 14.6418%   | 0.0043%           | 6.5466%                | 0.0000%                   | 8.0952% | 0.0043% |



## 十四、基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用和账户维护费用；
- 10、基金上市费及年费；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人自动于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.09% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.09\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人自动于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3. 基金销售服务费

本基金年销售服务费率为0.25%，销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人自动于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类中第4—11项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人刊登的本基金原招募说明书（《博时保证金实

时交易型货币市场基金招募说明书》)进行了更新,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要补充和更新的内容如下:

1、在“三、基金管理人”中,对基金管理人的基本情况进行了更新;

2、在“五、相关服务机构”中,对基金份额销售机构进行了更新;

3、在“八、基金的投资”中,更新了“(九)基金投资组合报告”的内容,数据内容截止时间为2019年09月30日;

4、在“九、基金的业绩”中,更新了基金业绩的内容,数据内容截止时间为2019年09月30日;

5、在“二十三、其他应披露的事项”中根据最新情况对相关应披露事项进行了更新。

(一)、2019年10月23日,我公司公告了《博时保证金实时交易型货币市场基金2019年第3季度报告》;

(二)、2019年09月02日,我公司公告了《关于博时保证金货币ETF基金一级申赎代办券商名单》;

(三)、2019年08月27日,我公司公告了《博时保证金实时交易型货币市场基金2019年半年度报告(摘要)》;

(四)、2019年07月18日,我公司公告了《博时保证金实时交易型货币市场基金2019年第2季度报告》;

(五)、2019年07月09日,我公司公告了《博时保证金实时交易型货币市场基金更新招募说明书2019年第2号(摘要)》。

6、根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订招募说明书相关内容。

博时基金管理有限公司

2019年12月31日