博时现金收益证券投资基金

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：交通银行股份有限公司**

**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。

基金托管人交通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。

根据基金管理人2019年11月29日发布的《博时基金管理有限公司关于博时现金收益证券投资基金增加基金份额类别并修改基金契约和托管协议的公告》，自2019年12月3日起对博时现金收益证券投资基金增设C类基金份额类别，具体内容请查阅指定报刊上的各项相关公告。

## §2 基金产品概况

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 基金简称 | 博时现金收益货币 | | |
| 基金主代码 | 050003 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2004年1月16日 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 166,277,139,719.25份 | | |
| 投资目标 | 在保证低风险和高流动性的前提下获得高于投资基准的回报。 | | |
| 投资策略 | 本基金根据短期利率的变动和市场格局的变化，积极主动地在债券资产和回购资产之间进行动态的资产配置。 | | |
| 业绩比较基准 | 本基金成立于2004年1月16日，业绩比较基准是一年期定期存款利率（税后）；自2009年7月1日起，本基金的业绩比较基准变更为：活期存款利率（税后）。 | | |
| 风险收益特征 | 现金收益证券投资基金投资于短期资金市场基础工具，由于这些金融工具的特点，因此整个基金的风险处于较低的水平。但是，本基金依然处于各种风险因素的暴露之中，包括利率风险、再投资风险、信用风险、操作风险、政策风险和通货膨胀风险等等。 | | |
| 基金管理人 | 博时基金管理有限公司 | | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 博时现金收益货币A | 博时现金收益货币B | 博时现金收益货币C |
| 下属分级基金的交易代码 | 050003 | 000665 | 008393 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 163,722,158,088.51份 | 2,553,965,346.15份 | 1,016,284.59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) | | |
| 博时现金收益货币A | 博时现金收益货币B | 博时现金收益货币C |
| 1.本期已实现收益 | 935,745,528.15 | 20,166,487.83 | 1,836.17 |
| 2.本期利润 | 935,745,528.15 | 20,166,487.83 | 1,836.17 |
| 3.期末基金资产净值 | 163,722,158,088.51 | 2,553,965,346.15 | 1,016,284.59 |

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．博时现金收益货币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 | 0.5779% | 0.0002% | 0.0894% | 0.0000% | 0.4885% | 0.0002% |

2．博时现金收益货币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 | 0.6387% | 0.0002% | 0.0894% | 0.0000% | 0.5493% | 0.0002% |

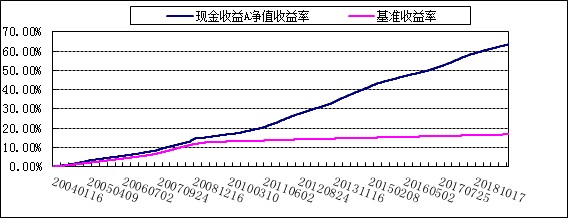
3．博时现金收益货币C：

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 | 0.1823% | 0.0002% | 0.0272% | 0.0000% | 0.1551% | 0.0002% |

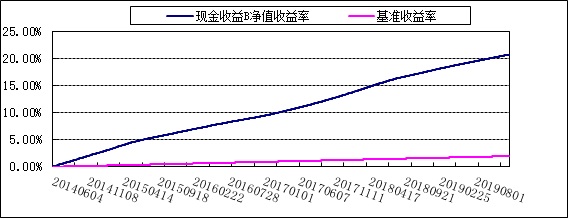
注：自2019年12月3日起对本基金增设C类基金份额类别，增设C类基金份额类别后，本基金将分设三类基金份额：A类基金份额、B类基金份额和C类基金份额。三类基金份额分设不同的基金代码，分别计算基金份额净值。

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

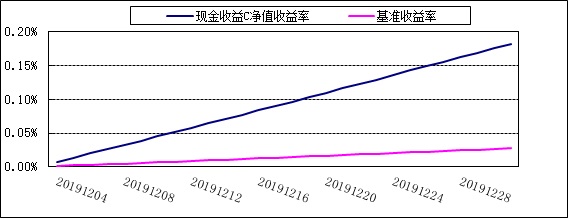
1．博时现金收益货币A：



2．博时现金收益货币B：



3．博时现金收益货币C：



注：自2019年12月3日起对本基金增设C类基金份额类别，增设C类基金份额类别后，本基金将分设三类基金份额：A类基金份额、B类基金份额和C类基金份额。

## §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 |
| 魏桢 | 固定收益总部现金管理组负责人/基金经理 | 2015-05-22 | - | 11.5 | 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)、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-2019年11月12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)、博时合惠货币市场基金(2017年5月31日—至今)、博时安弘一年定期开放债券型发起式证券投资基金(2019年11月12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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

四季度经济、金融数据显示宏观经济整体平稳，下行压力未进一步凸显。具体来看，规模以上工业增加值累计增速从8月5.6%一直延续至11月。固定资产投资累计增速从9月份5.4%小幅下跌至11月份5.2%，源于基建、房地产投资和制造业投资等分项同时回落。中美贸易摩擦短期好转并未立即体现在出口数据上，11月份出口累计增速为-0.3%，较三季度末-0.1%略有下行。金融数据方面，11月M2增速8.2%，较9月份 8.4%小幅下行；新增社融规模整体稳定，其中企业中长期贷款占比继续微幅改善。通胀方面，猪肉价格上涨加速带动CPI在11月份升高至4.5%，较前三季度值大幅上行。

货币政策保持稳健基调，既强调流动性合理充裕又不“大水漫灌”。资金利率走势前平后低，12月中旬前央行保持正常投放节奏，资金利率延续前期均衡水平，随后受央行大力投放跨年逆回购和财政存款集中支出因素叠加影响资金利率中枢快速下行，隔夜回购利率一度跌破1%。存款、存单等货币市场工具利率在12月中旬前受到年末因素影响逐渐上行，随后在跨年资金面情绪稳定后快速向下。四季度期间银行间质押式回购R001和R007利率均值分别为2.22%、2.68%，较三季度平均值下降18bp和2bp。

展望后市，经济基本面波动斜率预计将降低。财政政策发力时点前置对冲经济下行压力，经济总体保持韧性。预计CPI高开低走，PPI低位缓步回升。货币政策作为影响流动性的最关键变量，央行始终强调其稳健基调，在保持定力不搞大水漫灌和应对经济下行两个方向间寻找平衡。短期内降低社会融资成本、配合积极财政政策操作、维护金融稳定等目标决定了货币政策仍将延续宽松，货币市场利率难有显著上行空间。尽管央行操作仍会有利于货币市场，但政策的灵活性也会带来预期差，投资上需要密切注意安全边际。

本基金预判货币市场利率走势，主动调整资产到期现金流分布，利用年末货币市场利率高点大力配置同业存单、存款、逆回购等资产，拉长组合平均剩余期限，保持适度杠杆操作，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类基金份额净值收益率为0.5779%，本基金B类基金份额净值收益率为0.6387%，同期业绩基准收益率为0.0894%；本基金C类基金份额净值收益率为0.1823%，同期业绩基准收益率为0.0272%。

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 | 52,753,691,029.66 | 31.18 |
|  | 其中：债券 | 52,323,691,029.66 | 30.92 |
|  | 资产支持证券 | 430,000,000.00 | 0.25 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 买入返售金融资产 | 48,104,196,453.90 | 28.43 |
|  | 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 | 68,008,283,071.42 | 40.19 |
| 5 | 其他资产 | 346,424,262.35 | 0.20 |
| 6 | 合计 | 169,212,594,817.33 | 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 | 1.13 | |
|  | 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 | 2,824,411,374.61 | 1.70 |
| 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 | 80 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 83 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 62 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过120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120天。

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 | 28.82 | 1.70 |
|  | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天（含）—60天 | 21.20 | - |
|  | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天（含）—90天 | 21.47 | - |
|  | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天（含）—120天 | 6.04 | - |
|  | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120天（含）—397天（含） | 24.03 | - |
|  | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 101.56 | 1.70 |

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存续期未超过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 | 摊余成本（元） | 占基金资产净值比例(％) |
| 1 | 国家债券 | 4,062,111,731.95 | 2.44 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 4,311,536,310.07 | 2.59 |
|  | 其中：政策性金融债 | 4,311,536,310.07 | 2.59 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 350,000,914.19 | 0.21 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 43,600,042,073.45 | 26.22 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 52,323,691,029.66 | 31.47 |
| 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 | 111909198 | 19浦发银行CD198 | 25,000,000 | 2,482,796,177.43 | 1.49 |
| 2 | 111986622 | 19徽商银行CD078 | 20,000,000 | 1,974,300,998.82 | 1.19 |
| 3 | 111987968 | 19南京银行CD070 | 20,000,000 | 1,971,736,801.65 | 1.19 |
| 4 | 111908127 | 19中信银行CD127 | 19,000,000 | 1,886,925,094.89 | 1.13 |
| 5 | 111911043 | 19平安银行CD043 | 16,000,000 | 1,590,921,007.69 | 0.96 |
| 6 | 111910117 | 19兴业银行CD117 | 16,000,000 | 1,590,801,470.97 | 0.96 |
| 7 | 111908049 | 19中信银行CD049 | 16,000,000 | 1,589,143,278.81 | 0.96 |
| 8 | 111914148 | 19江苏银行CD148 | 16,000,000 | 1,583,475,506.78 | 0.95 |
| 9 | 111912067 | 19北京银行CD067 | 16,000,000 | 1,571,170,368.71 | 0.94 |
| 10 | 111907110 | 19招商银行CD110 | 14,000,000 | 1,390,365,859.25 | 0.84 |

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 | 0.0179% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0135% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0054% |

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%。

5.8 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 | 159974 | 弘花01A | 2,600,000.00 | 260,000,000.00 | 0.16 |
| 2 | 165038 | 19花04A1 | 1,700,000.00 | 170,000,000.00 | 0.10 |

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CD067(111912067)、19中信银行CD127(111908127)、19中信银行CD049(111908049)、19江苏银行CD148(111914148)、19南京银行CD070(111987968)、19招商银行CD110(111907110)、19徽商银行CD078(111986622)、19平安银行CD043(111911043)、19浦发银行CD198(111909198)、19兴业银行CD117(111910117)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。

2019年2月3日，因存在未按业务实质准确计量风险资产等违规行为，中国银行业监督管理委员会江苏监管局对江苏银行股份有限公司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7月8日，因存在未采取有效手段持续监测借款人账户进出等违规行为，中国银行业监督管理委员会蚌埠监管分局对徽商银行股份有限公司蚌埠分行处以罚款的行政处罚。

2019年4月24日，因存在未经批准设立分支机构等违规行为，中国银行保险监督管理委员会河北监管局对平安银行股份有限公司石家庄分行处以罚款的行政处罚。

2019年10月10日，因存在信贷资金转存定期存单并用于开立银行承兑汇票、违规办理委托贷款业务、资金监控不到位等违规行为，中国银行保险监督管理委员会北京监管局对上海浦东发展银行北京分行处以罚款的行政处罚。

2019年10月18日，因存在严重违反审慎经营规则办理票据业务的违规行为，中国银行业监督管理委员会辽宁监管局对兴业银行股份有限公司沈阳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。

5.9.3 其他各项资产构成

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 名称 | 金额(元) |
| 1 | 存出保证金 | 21,726.33 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 335,505,072.99 |
| 4 | 应收申购款 | 10,897,463.03 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 346,424,262.35 |

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 | 博时现金收益货币A | 博时现金收益货币B | 博时现金收益货币C |
| 本报告期期初基金份额总额 | 164,086,367,419.01 | 2,923,687,425.59 | - |
| 报告期基金总申购份额 | 631,834,550,427.70 | 2,685,745,283.15 | 1,016,284.59 |
| 报告期基金总赎回份额 | 632,198,759,758.20 | 3,055,467,362.59 | - |
| 报告期基金拆分变动份额 | - | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 163,722,158,088.51 | 2,553,965,346.15 | 1,016,284.59 |

注：根据基金管理人2019年11月29日发布的《博时基金管理有限公司关于博时现金收益证券投资基金增加基金份额类别并修改基金契约和托管协议的公告》，自2019年12月3日起对博时现金收益证券投资基金增设C类基金份额类别，具体内容请查阅指定报刊上的各项相关公告。

## §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 | 2019-12-04 | 1,000,000.00 | 1,000,000.00 | 0.00% |
| 合计 |  |  | 1,000,000.00 | 1,000,000.00 |  |

## §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)、博时中证银联智惠大数据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现金收益证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时现金收益证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时现金收益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博时现金收益证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6报告期内博时现金收益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**