

博时月月薪定期支付债券型证券投资基金
2022年第3季度报告
2022年9月27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：二〇二二年十月二十六日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 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 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 27 日止。本基金自 2022 年 9 月 28 日起进入清算期。

§2 基金产品概况

基金简称	博时月月薪债券
基金主代码	000246
交易代码	000246
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 7 月 25 日
报告期末基金份额总额	43,695,285.15 份
投资目标	在谨慎投资的前提下，本基金力争为投资人提供稳定的现金流收入，争取实现超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为债券型基金。运作周期内，本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法，确定资产在非信用类固定收益类证券（国家债券、中央银行票据等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例。本基金的主要投资策略是买入与封闭期相匹配的债券，并持有到期，或者是持有回售期与封闭期相匹配的债券，获得本金和票息收入。 自由开放期内，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。
业绩比较基准	3 年期定期存款利率（税后）。每个运作周期首日，3 年期定期存款利率根据当日中国人民银行公布并执行的利率水平调整。
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。
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

§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 (2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 27 日)
1.本期已实现收益	641,640.39
2.本期利润	704,629.95
3.加权平均基金份额本期利润	0.0059
4.期末基金资产净值	43,493,929.87
5.期末基金份额净值	0.995

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（不包含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

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	0.40%	0.05%	0.67%	0.01%	-0.27%	0.04%
过去六个月	0.20%	0.07%	1.36%	0.01%	-1.16%	0.06%
过去一年	1.49%	0.06%	2.73%	0.01%	-1.24%	0.05%
过去三年	14.37%	0.08%	8.23%	0.01%	6.14%	0.07%
过去五年	27.59%	0.09%	13.73%	0.01%	13.86%	0.08%
自基金合同生 效起至今	74.07%	0.11%	27.99%	0.01%	46.08%	0.10%

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



§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		
王帅	基金经理	2022-01-24	-	7.2	王帅先生，硕士。2015 年从复旦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、高级研究员兼基金经理助理、资深研究员兼基金经理助理。现任博时富融纯债债券型证券投资基金(2022 年 1 月 24 日—至今)、博时汇享纯债债券型证券投资基金(2022 年 1 月 24 日—至今)、博时富悦纯债债券型证券投资基金(2022 年 1 月 24 日—至今)、博时月月薪定期支付债券型证券投资基金(2022 年 1 月 24 日—至今)、博时裕鹏纯债债券型证券投资基金(2022 年 1 月 24 日—至今)、博时慧选纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2022 年 1 月 24 日—至今)、博时利发纯债债券型证券投资基金(2022 年 1 月 24 日—至今)

				今)、博时聚润纯债债券型证券投资基金(2022 年 1 月 24 日—至今)、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(2022 年 1 月 24 日—至今)、博时裕康纯债债券型证券投资基金(2022 年 1 月 24 日—至今)、博时裕达纯债债券型证券投资基金(2022 年 1 月 24 日—至今)、博时安怡 6 个月定期开放债券型证券投资基金(2022 年 1 月 24 日—至今)、博时富元纯债债券型证券投资基金(2022 年 3 月 16 日—至今)、博时安丰 18 个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)(2022 年 9 月 9 日—至今)的基金经理, 博时双月薪定期支付债券型证券投资基金、博时安康 18 个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)、博时双季鑫 6 个月持有期混合型证券投资基金、博时富尊纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理。
--	--	--	--	---

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，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

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 25 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

2022 年三季度债券市场波动有所放大，收益率呈现先上后下再上的形态，整体受益于央行意外降息和地产修复弱于预期，收益率整体下行，赚钱效应较好。7 月初央行超预期缩量 OMO 操作，市场对资金面收紧产生恐慌，收益率有所上行；但中旬地产行业再次出现恶化，市场对经济修复的预期进一步恶化，资金面也进一步宽松，收益率开始震荡下行；8 月 15 日央行超预期降息，引发市场的做多热情，收益率快速下行，但 10 年国债收益率在下行至 2.6% 附近的心理点位后开始震荡盘整，其间受疫情反弹而有所反复；9 月下旬海外环境变幻莫测，人民币汇率加速贬值，国内资产普遍承压，同时市场开始担心地产政策发力，收益率在 9 月末快速反弹，其中 10 年国债收益率低点反弹近 18bp。整个三季度来看，10 年国债收益率下行 6bp，3 年国开收益率下行 22bp，10 年国开收益率下行 12bp；信用利差依然保持低位震荡。

从指数看，三季度中债总财富指数上涨 1.54%，中债国债总财富指数上涨 1.61%，中债企业债总财富指数上涨了 1.67%，中债短融总财富指数上涨了 0.66%。

三季度，本基金紧密跟踪宏观基本面、政策走向及市场态势，及时作出应对，保持合适杠杆，组合久期根据市场判断灵活调整，信用债投资在守住信用风险的基础上强化精细化管理。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 09 月 27 日，本基金基金份额净值为 0.995 元，份额累计净值为 1.741 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 0.40%，同期业绩基准增长率 0.67%。

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	-	-

	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	58,240,187.35	100.00
8	其他各项资产	2,365.45	0.00
9	合计	58,242,552.80	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 报告期内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	2,355.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,365.45

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

本报告期期初基金份额总额	138,112,002.44
报告期期间基金总申购份额	180.66
减：报告期期间基金总赎回份额	95,527,282.15
报告期期间基金拆分变动份额	1,110,384.20
本报告期期末基金份额总额	43,695,285.15

§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。

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

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 2022 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理 335 只公募基金，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 16597 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5970 亿元人民币，累计分红逾 1721 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时月月薪定期支付债券型证券投资基金设立的文件

9.1.2 《博时月月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》

9.1.3 《博时月月薪定期支付债券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 博时月月薪定期支付债券型证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6 报告期内博时月月薪定期支付债券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询，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
二〇二二年十月二十六日