博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

2018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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§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2018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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时稳健回报债券(LOF)	
场内简称	稳健债A	
基金主代码	160513	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月10日	
报告期末基金份额总额	57,755,511.63份	
投资目标	在谨慎投资的前提下,本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益	
投资策略	通过宏观方面自上而下的分析及债券市场方面自下而上的判断,把握市场利率水平的运行态势,根据债券市场收益率曲线的整体运动方向进行久期选择。在微观方面,基于债券市场的状况,主要采用骑乘、息差及利差策略等投资策略。同时积极参与一级市场新股、债券申购,提高组合预期收益水平	
业绩比较基准	中证全债指数收益率	
风险收益特征	从基金整体运作来看,本基金属于中低风险品种,预期收益和风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金	
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	
下属分级基金的基金简称	博时稳健回报债券(LOF)A	博时稳健回报债券(LOF)C
下属分级基金的场内简称	稳健债A	稳健债C
下属分级基金的交易代码	160513	160514
报告期末下属分级基金的份额总额	5,146,553.99份	52,608,957.64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(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	博时稳健回报债券(LOF)A	博时稳健回报债券(LOF)C
1.本期已实现收益	-72,761.64	-713,844.29
2.本期利润	49,073.43	383,181.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0094	0.0072
4.期末基金资产净值	7,170,414.77	64,461,655.25
5.期末基金份额净值	1.393	1.225

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. 博时稳健回报债券(LOF)A:

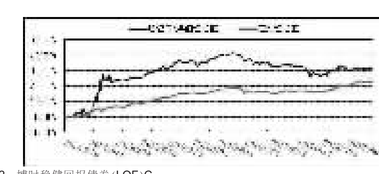
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.65%	0.13%	1.35%	0.07%	-0.70%	0.06%

2. 博时稳健回报债券(LOF)C:

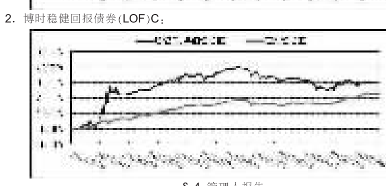
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.57%	0.12%	1.35%	0.07%	-0.78%	0.05%

3.2.2 自基金转型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. 博时稳健回报债券(LOF)A:



2. 博时稳健回报债券(LOF)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		
邓欣雨	基金经理	2018-04-23	-	10.0	邓欣雨先生,硕士。2008年硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任固定收益研究员、固定收益研究员兼基金经理助理、博时聚瑞纯债债券型证券投资基金(2016.05.26-2017.11.08)、博时富祥纯债债券型证券投资基金(2016.11.10-2017.11.16)、博时聚利纯债债券型证券投资基金(2016.09.18-2017.11.22)、博时兴盛货币市场基金(2016.12.21-2017.12.29)、博时泰和债券型证券投资基金(2016.05.25-2018.03.09)、博时兴荣货币市场基金(2017.02.24-2018.03.19)、博时悦楚纯债债券型证券投资基金(2016.09.09-2018.04.09)、博时双债增强债券型证券投资基金(2015.07.16-2018.05.05)、博时慧选纯债债券型证券投资基金(2016.12.19-2018.07.30)、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(2018.07.30-2018.08.09)的基金经理。现任博时转债增强债券型证券投资基金(2013.09.25一至今)、博时裕利纯债债券型证券投资基金(2016.05.09一至今)、博时聚盈纯债债券型证券投资基金(2016.07.27一至今)、博时景发纯债债券型证券投资基金(2016.08.03一至今)、博时聚润纯债债券型证券投资基金(2016.08.30一至今)、博时利发纯债债券型证券投资基金(2016.09.07一至今)、博时富发纯债债券型证券投资基金(2016.09.07一至今)、博时富元纯债债券型证券投资基金(2017.02.16一至今)、博时富诚纯债债券型证券投资基金(2017.03.17一至今)、博时富和纯债债券型证券投资基金(2017.08.30一至今)、博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)(2018.04.23一至今)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,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

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

3季度债券市场放缓上涨的节奏,中债总财富指数上涨1.00%,短端表现好于长端,这符合“宽货币和宽信用”政策组合拳的基调。在保持流动性合理充裕的基调下,市场资金面较为宽松,可观察到货币基金7日年化收益率基本下行100bp,季度末时破3%已成为常态。受流动性宽松影响,中短端债券表现相对较为突出,而受宽信用预期影响,以及高油价下通胀预期和美债收益率走高等负面因素制约,同时3季度中后期大量地方债发行,长端利率债表现较为一般,中债总财富指数(1-3年)上涨1.51%,中债国债总财富指数(7-10年)下跌0.08%。从整个3季度看,10年国债收益率震荡上行10bp左右至3.6%附近,10年国开债窄幅震荡维持在4.2%左右,而3年期信用债收益率有40-50bp的下行。虽然信用环境边际上有所改善,特别是政策上对城投债有明显的支撑,但债市违约数量仍有明显增加,投资者对低等级品种仍然非常谨慎,特别是民营企业债券。操作上,根据组合规模等特征,主要尝试利率债的波动操作,伺机增持交易所中短期信用债,另外灵活参与可转债市场。

展望未来,目前多空因素交织,短期债券市场仍处于震荡状态的概率偏高。关于多空因素,中长期看基本面下行压力对债市是偏正面的,在基本面预期不佳情况下,正常情况下国内是需要偏低的利率环境,资金面方面问题不大,保持流动性合理充裕已是明显的定调,从10月份再次降准100bp可以看出央行对维持资金面稳定的呵护,而且9月份美联储加息后国内再次并未跟随,看来央行对当前短端利率是满意的,除非出现新的超预期变化,另外需关注汇率变化和定位。高位油价、美债走高等对国内利率形成一定制约,较为偏负面。在震荡市期间,投资上需回归赚取票息的本源,诸如1-3年短久期信用债应是不错选择,且此期限段内的骑乘收益也明显。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年09月30日,本基金A类基金份额净值为1.393元,份额累计净值为1.468元,本基金C类基金份额净值为1.225元,份额累计净值为1.325元。报告期内,本基金A基金份额净值增长率为0.65%,本基金C基金份额净值增长率为0.57%,同期业绩基准增长率1.35%。

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	固定收益投资	67,172,654.87	87.84
	其中:债券	67,172,654.87	87.84
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	6,500,000.00	8.50
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,799,178.89	2.35
7	其他各项资产	1,004,103.59	1.31
8	合计	76,475,937.35	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

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	165,792.40	0.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	42,865,646.00	59.84
	其中:政策性金融债	42,865,646.00	59.84
4	企业债券	13,795,021.00	19.26
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	10,346,195.47	14.44
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	67,172,654.87	93.77

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	018005	国开1701	244,410	24,587,646.00	34.32
2	160213	16国开13	200,000	18,278,000.00	25.52
3	122392	15恒大02	42,030	4,232,421.00	5.91
4	112674	18亚迪01	40,000	3,984,000.00	5.56
5	136140	16富力01	40,000	3,977,600.00	5.55

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

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 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

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	2,071.07
2	应收证券清算款	187,191.08
3	应收股利	-
4	应收利息	813,841.44
5	应收申购款	1,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,004,103.59

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113018	常熟转债	2,084,503.20	2.91
2	128015	久其转债	1,833,600.00	2.56
3	132005	15国资EB	1,442,574.00	2.01
4	128034	江银转债	1,025,556.45	1.43
5	132009	17中油EB	716,220.00	1.00
6	123007	道氏转债	355,120.00	0.50
7	128029	太阳转债	239,217.12	0.33
8	110043	无锡转债	129,610.80	0.18
9	128035	大族转债	3,132.00	0.00
10	127005	长证转债	956.20	0.00
11	113505	杭电转债	895.00	0.00

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	博时稳健回报债券(LOF)A	博时稳健回报债券(LOF)C
本报告期期初基金份额总额	5,233,279.87	53,056,564.88
报告期基金总申购份额	58,099.36	1,287,640.92
减:报告期基金总赎回份额	144,825.24	1,735,248.16
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,146,553.99	52,608,957.64

§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

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2018年09月30日,博时基金公司共管理177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,以及多个企业年金账户,管理资产总规模逾8169亿元人民币,其中非货币公募基金规模逾1964亿元人民币,累计分红逾894亿元人民币,是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一,养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计,截至2018年3季末:

博时旗下权益类基金业绩表现持续稳健。今年以来A股市场剧烈震荡,在参与银河排名的99只权益产品(各类份额分开计算)中,共49只银河同类排名前1/2。其中,股票型基金里,博时国企改革主题、博时丝路主题、博时工业4.0、博时军工主题业绩均排名银河同类前1/4;混合型基金当中,博时沪港深成长、博时汇智回报、博时新收益、博时鑫泰、博时新策略等多只基金业绩排名银河同类前1/8,博时新兴消费、博时裕隆、博时乐臻、博时新策略、博时鑫瑞、博时鑫丰、博时新价值等多只基金业绩排名银河同类前1/4,博时精选、博时创业成长、博时沪港深价值优选、博时鑫源、博时鑫润、博时新起点等多只基金业绩排名银河同类前1/2;指数型基金当中,博时上证超大盘ETF及其联接基金、中证银行分级指数等产品业绩排名银河同类前1/10,博时上证50ETF及其联接基金业绩排名银河同类前1/6,博时裕富沪深300指数业绩排名银河同类前1/3,博时银智大数据100指数、博时深证基本面200ETF、博时上证自然资源ETF、博时上证800证保分级等多只产品业绩排名银河同类前1/2。

博时固定收益类基金业绩表现优异。总计106只各类型债券基金中共有86只(各类份额分开计算)今年以来收益率超过全市场债券平均收益率(3.25%),16只货币基金中共有11只(各类份额分开计算)今年以来收益率超过全市场货币基金平均收益率(2.79%),在参与银河排名的115只固收产品(各类份额分开计算)中,有55只产品银河同类排名前1/2。其中,博时裕瑞纯债、博时利发纯债、博时裕康纯债今年以来净值增长率为7.38%、6.48%、6.02%,同类309只基金中分别排名第3、第10、第20位,博时天颐债券(A类)、博时宏观回报债券(A/B类)、博时信用债券(A/B类)今年以来净值增长率分别为6.07%、4.65%、4.36%,同类210只基金中分别排名第5、第17、第23位,博时天颐债券(C类)、博时信用债券(R类)今年以来净值增长率分别为5.68%、4.36%,同类148只基金中分别排名第4、第14,博时裕利纯债债券、博时富瑞纯债债券今年以来净值增长率分别为5.81%、5.76%,同类排名前1/8;货币基金类,博时合惠货币(A类)今年以来净值增长率为3.15%,在312只同类基金排名中位列第14位。

商品型基金当中,博时黄金ETF联接(A类)、博时黄金ETF联接(C类)今年以来净值增长率同类排名第一。

QDII基金方面,博时标普500ETF(QDII)、博时标普500ETF联接(QDII)(A类),今年以来净值增长率同类排名均位于前1/3。

2、其他大事件

2018年9月7日,由证券时报主办的“2018中国AI金融探路者峰会暨第二届中国金融科技先锋”榜颁奖典礼在深圳举行,凭借长期的敬业精神和沉淀的创新思维,博时基金副总裁王德英获得了“2018中国金融科技领军人物先锋”的荣誉。

2018年9月6-9日,在阿拉善生态基金会主办,深圳证券信息、全景网协办,深交所、证券业协会、基金业协会、期货业协会、上市公司协会等单位支持的"2018第三届绿色行走公益长征暨沙漠穿越挑战·赛"中,由4名博时员工朱盟(信息技术部)、过钧(固定收益总部)、王飞(信息技术部)、王盼(信息技术部)组成的代表队,成功穿越内蒙古阿拉善盟腾格里沙漠,率先全员抵达终点获得团体冠军,其中王飞更获得个人第一。

2018年8月,全国社会保障基金境内委托投资管理人2017年度考评结果出炉,博时基金投研能力获得高度认可,在公司基本面单项考评中获A档,三个社保委托组合获评“综合考评A档”,此为社保考评结果的最高档。同时,在社保投资经理的考评中,博时基金共收获3项个人奖项。博时基金副总裁兼高级投资经理董良泓独揽社保理事会特别颁发的“10年长期贡献社保表彰”,用于肯定其过去十年在同一家公司管理社保组合,含金量极高。同时,董良泓本人还摘得“10年贡献社保表彰”的殊荣,该奖项授予长期为社保服务且业绩优秀的投资管理人,本次仅授予2人。此外,博时基金董事总经理兼年金投资部总经理欧阳凡获评“3年贡献社保表彰”。

2018年7月19日,由中国证券投资基金业协会主办的“中国基金业20周年——发展中的思考与启示”主题论坛在深圳隆重举行。博时基金凭借雄厚的资管实力、出色的投研业绩、锐意创新的拼搏精神获得基金业协会的高度认可,一举摘得“优秀基金管理人”大奖;副总经理王德英此次荣获“杰出专业人士”的殊荣。同时,博时主题行业混合(LOF)(160505)更是以长期优异的业绩上榜“优秀基金产品”。

§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稳健回报债券型证券投资基金(LOF)募集的文件

9.1.2《博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)基金合同》

9.1.3《博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)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 博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)各年度审计报告正本

9.1.6 关于申请募集博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)之法律意见书

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
二〇一八年十月二十五日

博时稳定价值债券投资基金

2018年第三季度报告

2018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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时稳定价值债券	
基金主代码	050006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007年9月6日	
报告期末基金份额总额	376,146,190.93份	
投资目标	本基金为主动式管理的债券型基金。本基金通过对宏观经济分析和债券等固定收益市场分析,对基金投资组合做出相应的调整,力争为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金通过宏观经济和债券市场自上而下和自下而上的分析,把握市场利率水平的运行态势,根据债券市场收益率曲线的整体运动方向制定具体的投资策略。	
业绩比较基准	中证综合债券指数 今后如果市场出现更具代表性的业绩比较基准,或者更科学的复合指数权重比例,在与基金托管人协商一致后,本基金管理人可调整或变更本基金的业绩比较基准。	
风险收益特征	本基金属于证券市场中的低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于股票型基金。	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博时稳定价值债券A	博时稳定价值债券B
下属分级基金的交易代码	050106(前端)、051106(后端)	050006
报告期末下属分级基金的份额总额	127,286,977.18份	248,859,213.75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(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	博时稳定价值债券A	博时稳定价值债券B
1.本期已实现收益	847,793.02	1,315,215.58
2.本期利润	1,806,395.02	4,982,160.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0170	0.0189
4.期末基金资产净值	190,694,826.61	365,614,763.44
5.期末基金份额净值	1.498	1.469

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. 博时稳定价值债券A:

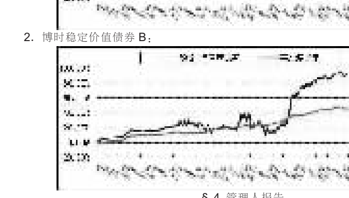
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.35%	0.09%	1.32%	0.06%	0.03%	0.03%

2. 博时稳定价值债券B:

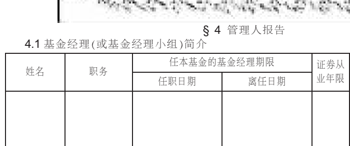
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.31%	0.09%	1.32%	0.06%	-0.01%	0.03%

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. 博时稳定价值债券A:



2. 博时稳定价值债券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		
张李陵	基金经理	2015-05-22	-	6.0	张李陵先生,硕士。2006年起先后在招商银行、融通基金工作。2014年加入博时基金管理有限公司。历任投资经理、投资经理兼基金经理助理、博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金(2016.08.01-2017.06.27)、博时泰安债券型证券投资基金(2016.12.27-2018.03.08)、博时泰和债券型证券投资基金(2016.07.13-2018.03.09)、博时富鑫纯债债券型证券投资基金(2017.02.10-2018.07.16)的基金经理。现任博时稳定价值债券投资基金(2015.05.22一至今)、博时信用债纯债债券型证券投资基金(2015.07.16一至今)、博时平衡配置混合型证券投资基金(2015.07.16一至今)、博时天颐债券型证券投资基金(2016.08.01一至今)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

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,债券市场先下后上,总体呈现区间震荡格局。二季度末,市场信用风险加剧,同时贸易战愈演愈烈,央行开启宽松予以应对。7月份,央行继续降准,延续了6月份维持宽松的格局,再度开启降准,短端大幅下行。但值得关注的是,短端大幅下行并未驱动长端大幅下行,长端在下行了大约20bps后,开启震荡格局。8月份,短端利率开始触底回升,长端利率出现了一定幅度的调整;9月份,短端继续维持平稳,长端利率也保持平稳。总体来看,债券市场的期限利差维持了较高的水平。组合采取了相对灵活的策略,适度参与利率交易。

长期看,债券市场依然处于牛市格局,但短期可能有一些东西需要更加明确。一是期限利差保持陡峭,是否是因为信贷市场出现了新的融资品种,使得信贷市场没有看起来这么弱,从而削弱了长端的表现;二是美国经济保持强劲,是否对我国汇率产生制约,从而阻碍货币政策的短期宽松;三是以工业品为主的大宗商品价格的上涨,是否会对长端有所影响。如果这三个因素被证伪,那么债券市场可能会迎来下一轮下行。组合操作上,也将积极把握这个机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年09月30日,本基金A类基金份额净值为1.498元,份额累计净值为1.882元,本基金B类基金份额净值为1.469元,份额累计净值为1.830元。报告期内,本基金A基金份额净值增长率为1.35%,本基金B基金份额净值增长率为1.31%,同期业绩基准增长率1.32%。

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	固定收益投资	659,730,300.10	96.83
	其中:债券	659,730,300.10	96.83
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,369,793.10	1.67
7	其他各项资产	10,241,874.46	1.50
8	合计	681,341,967.66	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

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	央行票据	-	-
3	金融债券	178,929,000.00	32.16
	其中:政策性金融债	138,961,000.00	24.98
4	企业债券	401,283,300.10	72.13
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	79,518,000.00	14.29
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	659,730,300.10	118.59

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	170215	17国开15	700,000	69,391,000.00	12.47
2	143303	17北方02	399,400	40,123,724.00	7.21
3	180210	18国开10	400,000	39,492,000.00	7.10
4	1680129	16皋开债	320,000	31,270,400.00	5.62
5	143594	18华数01	300,000	29,844,000.00	5.36

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

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 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

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	16,580.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,169,119.21
5	应收申购款	56,174.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,241,874.46

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	博时稳定价值债券A	博时稳定价值债券B
本报告期期初基金份额总额	80,766,798.25	276,730,698.14
报告期基金总申购份额	52,570,902.26	32,844,216.28
减:报告期基金总赎回份额	6,050,723.33	60,715,700.67
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	127,286,977.18	248,859,213.75

§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2018年09月30日,博时基金公司共管理177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,以及多个企业年金账户,管理资产总规模逾8169亿元人民币,其中非货币公募基金规模逾1964亿元人民币,累计分红逾894亿元人民币,是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一,养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计,截至2018年3季末:

博时旗下权益类基金业绩表现持续稳健。今年以来A股市场剧烈震荡,在参与银河排名的99只权益产品(各类份额分开计算)中,共49只银河同类排名前1/2。其中,股票型基金里,博时国企改革主题、博时丝路主题、博时工业4.0、博时军工主题业绩均排名银河同类前1/4;混合型基金当中,博时沪港深成长、博时汇智回报、博时新收益、博时鑫泰、博时新策略等多只基金业绩排名银河同类前1/8,博时新兴消费、博时裕隆、博时乐臻、博时新策略、博时鑫瑞、博时鑫丰、博时新价值等多只基金业绩排名银河同类前1/4,博时精选、博时创业成长、博时沪港深价值优选、博时鑫源、博时鑫润、博时新起点等多只基金业绩排名银河同类前1/2;指数型基金当中,博时上证超大盘ETF及其联接基金、中证银行分级指数等产品业绩排名银河同类前1/10,博时上证50ETF及其联接基金业绩排名银河同类前1/6,博时裕富沪深300指数业绩排名银河同类前1/3,博时银智大数据100指数、博时深证基本面200ETF、博时上证自然资源ETF、博时上证800证保分级等多只产品业绩排名银河同类前1/2。

博时固定收益类基金业绩表现优异。总计106只各类型债券基金中共有86只(各类份额分开计算)今年以来收益率超过全市场债券平均收益率(3.25%),16只货币基金中共有11只(各类份额分开计算)今年以来收益率超过全市场货币基金平均收益率(2.79%),在参与银河排名的115只固收产品(各类份额分开计算)中,有55只产品银河同类排名前1/2。其中,博时裕瑞纯债、博时利发纯债、博时裕康纯债今年以来净值增长率为7.38%、6.48%、6.02%,同类309只基金中分别排名第3、第10、第20位,博时天颐债券(A类)、博时宏观回报债券(A/B类)、博时信用债券(A/B类)今年以来净值增长率分别为6.07%、4.65%、4.36%,同类210只基金中分别排名第5、第17、第23位,博时天颐债券(C类)、博时信用债券(R类)今年以来净值增长率分别为5.68%、4.36%,同类148只基金中分别排名第4、第14,博时裕利纯债债券、博时富瑞纯债债券今年以来净值增长率分别为5.81%、5.76%,同类排名前1/8;货币基金类,博时合惠货币(A类)今年以来净值增长率为3.15%,在312只同类基金排名中位列第14位。

商品型基金当中,博时黄金ETF联接(A类)、博时黄金ETF联接(C类)今年以来净值增长率同类排名第一。

QDII基金方面,博时标普500ETF(QDII)、博时标普500ETF联接(QDII)(A类),今年以来净值增长率同类排名均位于前1/3。

2、其他大事件

2018年9月7日,由证券时报主办的“2018中国AI金融探路者峰会暨第二届中国金融科技先锋”榜颁奖典礼在深圳举行,凭借长期的敬业精神和沉淀的创新思维,博时基金副总裁王德英获得了“2018中国金融科技领军人物先锋”的荣誉。

2018年9月6-9日,在阿拉善生态基金会主办,深圳证券信息、全景网协办,深交所、证券业协会、基金业协会、期货业协会、上市公司协会等单位支持的"2018第三届绿色行走公益长征暨沙漠穿越挑战·赛"中,由4名博时员工朱盟(信息技术部)、过钧(固定收益总部)、王飞(信息技术部)、王盼(信息技术部)组成的代表队,成功穿越内蒙古阿拉善盟腾格里沙漠,率先全员抵达终点获得团体冠军,其中王飞更获得个人第一。

2018年8月,全国社会保障基金境内委托投资管理人2017年度考评结果出炉,博时基金投研能力获得高度认可,在公司基本面单项考评中获A档,三个社保委托组合获评“综合考评A档”,此为社保考评结果的最高档。同时,在社保投资经理的考评中,博时基金共收获3项个人奖项。博时基金副总裁兼高级投资经理董良泓独揽社保理事会特别颁发的“10年长期贡献社保表彰”,用于肯定其过去十年在同一家公司管理社保组合,含金量极高。同时,董良泓本人还摘得“10年贡献社保表彰”的殊荣,该奖项授予长期为社保服务且业绩优秀的投资管理人,本次仅授予2人。此外,博时基金董事总经理兼年金投资部总经理欧阳凡获评“3年贡献社保表彰”。

2018年7月19日,由中国证券投资基金业协会主办的“中国基金业20周年——发展中的思考与启示”主题论坛在深圳隆重举行。博时基金凭借雄厚的资管实力、出色的投研业绩、锐意创新的拼搏精神获得基金业协会的高度认可,一举摘得“优秀基金管理人”大奖;副总经理王德英此次荣获“杰出专业人士”的殊荣。同时,博时主题行业混合(LOF)(160505)更是以长期优异的业绩上榜“优秀基金产品”。

§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稳定价值债券投资基金设立的文件

9.1.2《博时稳定价值债券投资基金基金合同》

9.1.3《博时稳定价值债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 博时稳定价值债券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6 报告期内博时稳定价值债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
二〇一八年十月二十五日

博时睿远事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

2018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:中信建投证券股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§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。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2018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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时睿远事件驱动混合(LOF)
场内简称	博时睿远
基金主代码	160518
交易代码	160518
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年4月15日
报告期末基金份额总额	500,637,106.04份
投资目标	在封闭期内,本基金主要投资于定向增发的证券,基金管理人在严格控制风险的前提下,通过对定向增发证券投资价值的深入分析,力争基金资产的长期稳定增值。 转为上市开放式基金(LOF)后,本基金主要在对公司股票投资价值的长期跟踪和深入分析的基础上,挖掘和把握国内经济结构调整和升级的大背景下的事件性投资机会,力争基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将按照风险收益配比原则,实行动态的资产配置。在本基金的封闭期,基金管理人将主要采取一级市场参与定向增发策略。本基金转型为上市开放式基金(LOF)后,主要采用事件驱动的投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于中高预期风险、中高预期收益的基金品种。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中信建投证券股份有限公司

§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(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	4,798,686.02
2.本期利润	-18,446,047.25
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0363
4.期末基金资产净值	454,618,706.39
5.期末基金份额净值	0.908

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。

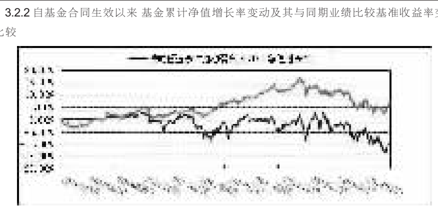
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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	-3.81%	1.10%	-0.15%	0.67%	-3.66%	0.43%

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		
陈鹏扬	权益投资GARP组投资副总监/基金经理	2017-10-17	-	9.9	陈鹏扬先生,硕士。2008年至2012年在中金公司工作。2012年加入博时基金管理有限公司。历任研究员、资深研究员、投资经理、博时睿远定增灵活配置混合型证券投资基金(2016.04.15-2017.10.16)、博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金(2016.05.31-2017.12.01)、博时睿益定增灵活配置混合型证券投资基金(2016.08.19-2018.02.22)、博时弘裕18个月定期开放债券型证券投资基金(2016.08.30-2018.05.05)、博时睿利事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2017.12.04-2018.08.13)的基金经理。现任权益投资GARP组投资副总监兼博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金(2015.08.24一至今)、博时弘盈定期开放混合型证券投资基金(2016.08.01一至今)、博时弘泰定期开放混合型证券投资基金(2016.12.09一至今)、博时睿丰灵活配置定期开放混合型证券投资基金(2017.03.22一至今)、博时弘康18个月定期开放债券型证券投资基金(2017.03.24一至今)、博时睿远事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2017.10.17一至今)、博时睿益事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2018.02.23一至今)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

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

3季度基金净值下跌,跑输基准,主要由于在周期类板块配置较少且市场下跌中仓位相对较高所致。

展望后市,我们认为经济下行压力将逐步体现,外需从明年开始面临较大下行压力;而国内去杠杆背景下政府基建投资力度难见明显提升,房地产销售走弱下地产投资也将进入下行通道。但当前市场估值已经下跌到比较有吸引力的水平,一批在国内具备领先优势的细分行业龙头估值从横向的国内外对比,以及纵向的历史比较而言都处于低位。我们认为后续市场仍存在结构性机会,对内需相关、通胀相关方向上的优质公司较为看好,对外需和投资相关的标的偏谨慎。

组合管理层面,我们将坚持从基本面研究出发,持续地在还在成长轨道的行业中寻找国内最有竞争力的公司,在合适的价格逐步配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年09月30日,本基金基金份额净值为0.908元,份额累计净值为0.908元。报告期内,本基金基金份额净值增长率为-3.81%,同期业绩基准增长率-0.15%。

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	381,892,373.58	83.68
	其中:股票	381,892,373.58	83.68
2	固定收益投资	1,103.40	0.00
	其中:债券	1,103.40	0.00
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	38,000,000.00	8.33
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	34,946,381.87	7.66
7	其他各项资产	1,513,813.94	0.33
8	合计	456,353,672.79	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	16,323,810.00	3.59
C	制造业	201,482,000.20	44.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	29,479,397.60	6.48
G	交通运输、仓储和邮政业	16,353,261.05	3.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,774,846.00	6.33
J	金融业	47,065,406.73	10.35
K	房地产业	42,413,652.00	9.33
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	381,892,373.58	84.00

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	000656	金科股份	8,219,700	42,413,652.00	9.33
2	002223	鱼跃医疗	2,119,126	39,394,552.34	8.67
3	600887	伊利股份	1,321,400	33,933,552.00	7.46
4	601398	工商银行	5,836,715	33,677,845.55	7.41
5	601933	永辉超市	3,617,104	29,479,397.60	6.48
6	300017	网宿科技	3,097,400	28,774,846.00	6.33
7	002422	科伦药业	929,869	24,799,606.23	5.46
8	600143	金发科技	4,934,700	21,860,721.00	4.81
9	603355	莱克电气	738,516	18,891,239.28	4.16
10	603056	德邦股份	748,433	16,353,261.05	3.60

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	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)	1,103.40	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,103.40	0.00

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	128029	太阳转债	10	1,103.40	0.00

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

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 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

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	293,617.30
2	应收证券清算款	1,237,857.52
3	应收股利	-
4	应收利息	-17,960.43
5	应收申购款	299.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,513,813.94

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128029	太阳转债	1,103.40	0.00

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未持有流通受限股票。

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	518,278,911.52
报告期基金总申购份额	394,173.87
减:报告期基金总赎回份额	18,035,979.35
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	500,637,106.04

§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2018年09月30日,博时基金公司共管理177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,以及多个企业年金账户,管理资产总规模逾8169亿元人民币,其中非货币公募基金规模逾1964亿元人民币,累计分红逾894亿元人民币,是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一,养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计,截至2018年3季末:

博时旗下权益类基金业绩表现持续稳健。今年以来A股市场剧烈震荡,在参与银河排名的99只权益产品(各类份额分开计算)中,共49只银河同类排名前1/2。其中,股票型基金里,博时国企改革主题、博时丝路主题、博时工业4.0、博时军工主题业绩均排名银河同类前1/4;混合型基金当中,博时沪港深成长、博时汇智回报、博时新收益、博时鑫泰、博时新策略等多只基金业绩排名银河同类前1/8,博时新兴消费、博时裕隆、博时乐臻、博时新策略、博时鑫瑞、博时鑫丰、博时新价值等多只基金业绩排名银河同类前1/4,博时精选、博时创业成长、博时沪港深价值优选、博时鑫源、博时鑫润、博时新起点等多只基金业绩排名银河同类前1/2;指数型基金当中,博时上证超大盘ETF及其联接基金、中证银行分级指数等产品业绩排名银河同类前1/10,博时上证50ETF及其联接基金业绩排名银河同类前1/6,博时裕富沪深300指数业绩排名银河同类前1/3,博时银智大数据100指数、博时深证基本面200ETF、博时上证自然资源ETF、博时上证800证保分级等多只产品业绩排名银河同类前1/2。

博时固定收益类基金业绩表现优异。总计106只各类型债券基金中共有86只(各类份额分开计算)今年以来收益率超过全市场债券平均收益率(3.25%),16只货币基金中共有11只(各类份额分开计算)今年以来收益率超过全市场货币基金平均收益率(2.79%),在参与银河排名的115只固收产品(各类份额分开计算)中,有55只产品银河同类排名前1/2。其中,博时裕瑞纯债、博时利发纯债、博时裕康纯债今年以来净值增长率为7.38%、6.48%、6.02%,同类309只基金中分别排名第3、第10、第20位,博时天颐债券(A类)、博时宏观回报债券(A/B类)、博时信用债券(A/B类)今年以来净值增长率分别为6.07%、4.65%、4.36%,同类210只基金中分别排名第5、第17、第23位,博时天颐债券(C类)、博时信用债券(R类)今年以来净值增长率分别为5.68%、4.36%,同类148只基金中分别排名第4、第14,博时裕利纯债债券、博时富瑞纯债债券今年以来净值增长率分别为5.81%、5.76%,同类排名前1/8;货币基金类,博时合惠货币(A类)今年以来净值增长率为3.15%,在312只同类基金排名中位列第14位。

商品型基金当中,博时黄金ETF联接(A类)、博时黄金ETF联接(C类)今年以来净值增长率同类排名第一。

QDII基金方面,博时标普500ETF(QDII)、博时标普500ETF联接(QDII)(A类),今年以来净值增长率同类排名均位于前1/3。

2、其他大事件

2018年9月7日,由证券时报主办的“2018中国AI金融探路者峰会暨第二届中国金融科技先锋”榜颁奖典礼在深圳举行,凭借长期的敬业精神和沉淀的创新思维,博时基金副总裁王德英获得了“2018中国金融科技领军人物先锋”的荣誉。

2018年9月6-9日,在阿拉善生态基金会主办,深圳证券信息、全景网协办,深交所、证券业协会、基金业协会、期货业协会、上市公司协会等单位支持的"2018第三届绿色行走公益长征暨沙漠穿越挑战·赛"中,由4名博时员工朱盟(信息技术部)、过钧(固定收益总部)、王飞(信息技术部)、王盼(信息技术部)组成的代表队,成功穿越内蒙古阿拉善盟腾格里沙漠,率先全员抵达终点获得团体冠军,其中王飞更获得个人第一。

2018年8月,全国社会保障基金境内委托投资管理人2017年度考评结果出炉,博时基金投研能力获得高度认可,在公司基本面单项考评中获A档,三个社保委托组合获评“综合考评A档”,此为社保考评结果的最高档。同时,在社保投资经理的考评中,博时基金共收获3项个人奖项。博时基金副总裁兼高级投资经理董良泓独揽社保理事会特别颁发的“10年长期贡献社保表彰”,用于肯定其过去十年在同一家公司管理社保组合,含金量极高。同时,董良泓本人还摘得“10年贡献社保表彰”的殊荣,该奖项授予长期为社保服务且业绩优秀的投资管理人,本次仅授予2人。此外,博时基金董事总经理兼年金投资部总经理欧阳凡获评“3年贡献社保表彰”。

2018年7月19日,由中国证券投资基金业协会主办的“中国基金业20周年——发展中的思考与启示”主题论坛在深圳隆重举行。博时基金凭借雄厚的资管实力、出色的投研业绩、锐意创新的拼搏精神获得基金业协会的高度认可,一举摘得“优秀基金管理人”大奖;副总经理王德英此次荣获“杰出专业人士”的殊荣。同时,博时主题行业混合(LOF)(160505)更是以长期优异的业绩上榜“优秀基金产品”。

§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睿远定增灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时睿远事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》

9.1.3《博时睿远事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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 报告期内博时睿远事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)在指定报刊上各项公告的原稿

9.1.6 博时睿远事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)各年度审计报告正本

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
二〇一八年十月二十五日