博时亚洲票息收益债券型证券投资基金

2018年第四季度报告

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:二〇一九年一月十九日

§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2019年1月18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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时亚洲票息收益债券
基金主代码	050030
交易代码	050030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年2月1日
报告期末基金份额总额	1,393,252,777.32份
投资目标	本基金通过分析亚洲区域各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面,寻找各类债券的投资机会,在谨慎投资的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	主要投资于亚洲市场的各类债券,以买入持有策略为主,配合信用策略、期限结构策略、互换策略等卫星策略。在谨慎投资的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return
风险收益特征	中等风险/收益的开放式基金
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
境外资产托管人英文名称	Brown Brothers Harriman Co.
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼银行

§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10月1日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	19,333,553.38
2.本期利润	-184,722.68
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0001
4.期末基金资产净值	1,822,872,952.32
5.期末基金份额净值	1.3084

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。

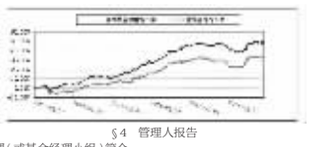
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-0.01%	0.23%	0.42%	0.24%	-0.43%	-0.01%

3.2.2自基金合同生效以来 基金累计净额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		
何凯	固定收益总部国际组投资总监/基金经理	2014-04-02	-	11.9	何凯先生,双硕士,CFA,2006年起先后在荷兰银行(伦敦),中国投资有限责任公司、南方东英资产管理有限公司从事投资研究工作。2012年12月加入博时基金管理有限公司。历任国际投资部副总经理、国际投资部副总经理兼基金经理助理、固定收益总部国际组投资副总监兼基金经理助理、固定收益总部国际组投资副总监。现任固定收益总部国际组投资总监兼博时亚洲票息收益债券型证券投资基金(2014年4月2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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度,美联储继续推进货币政策常态化进程,进行了一次加息,美国利率于上半季度继续攀升至多年高点后大幅回落直至年底,利率曲线牛市变平,期间中短端利率曲线还曾出现过倒挂。市场对未来的经济预期转为悲观,全球股票、大宗商品大幅下行,信用利差显著加宽。美元指数受避险情绪驱动维持高位,人民币维持稳定。

与全球市场一致,亚洲债券市场信用利差四季度持续加宽,其中投资级债券因信用利差加宽较小表现远好于高收益债券。从区域上看,台湾地区、韩国、菲律宾表现最强,中资债券表现略强于市场。中资债券中,值得一提的是高收益房地产债券在国内融资环境改善和政策放松预期的推动下,从十一月下旬开始出现了一波强力反弹。

在基金的操作上,我们总体超配高收益债券,虽然在市场开始反弹后及时增加了风险敞口,抓住了一些交易机会,但全季度表现仍弱于市场。

展望未来,美国经济基本面开始出现动摇并可能影响到全球,美联储的加息和缩表政策或在经济和市场双重压力下有所放缓甚至暂停,美国乃至全球利率上行压力减小。此外贸易争端及其他地缘政治风险所引起的不确定性还会对利率特别是长端利率形成进一步制约。信用方面,全球信用市场或仍面临压力,但中资信用债由于其有吸引力的估值,国内宽信用政策带来的实质性支撑以及市场供需环境的改善,仍然存在较好的配置价值。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,本基金基金份额净值为1.3084元,份额累计净值为1.4509元。报告期内,本基金基金份额净值增长率为-0.01%,同期业绩基准增长率0.42%。

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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,684,074,901.53	91.94
	其中:债券	1,684,074,901.53	91.94
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	116,645,418.89	6.37
8	其他各项资产	30,912,027.21	1.69
9	合计	1,831,632,347.63	100.00

注:金融衍生品投资项下的期货投资,在当日无负债结算制度下,结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益,则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货结算暂收款(结算所得的持仓损益)相抵消后的净额为0,具体投资情况详见下表:

期货类型	期货代码	期货名称	持仓量(买/卖)	合约价值(人民币元)	公允价值变动(人民币元)
汇率期货	XUCH9	USD/CNH Mar19	-200.00	137,578,000.00	86,060.00
总额合计					86,060.00
减:可抵消期货暂收款					86,060.00
期货投资净额					0.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
A	34,171,872.80	1.87
BBB	19,687,834.54	1.08
BBB-	29,135,958.62	1.60
BB+	32,965,648.24	1.81
BB	33,499,004.67	1.84
BB-	93,892,282.14	5.15
B+	199,512,194.53	10.94
B	384,897,075.21	21.11
B-	35,256,155.45	1.93
未评级	821,056,875.33	45.04

注:评级机构为标准普尔。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	XS1241497384	CHINSC 10 07/02/20	90,000	63,790,492.82	3.50
2	XS1219965297	CENCHI 8 3/4 01/23/21	90,000	62,185,739.40	3.41
3	XS1543555533	CAPG 6.35 01/11/20	80,000	54,728,254.91	3.00
4	XS1549245238	TPHL 6 1/4 01/23/20	70,000	47,601,370.77	2.61
5	XS1577730895	YZCOAL 5 3/4 PERP	70,000	47,566,780.24	2.61

注:债券代码为ISIN码。

5.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	期货投资(空头)	USD/CNH Mar19	86,060.00	0.00

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	2,156,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,599,409.57
5	应收申购款	1,156,617.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,912,027.21

5.10.4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。

5.10.5 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。

5.10.6 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

报告期期初基金份额总额	1,439,742,018.65
报告期基金总申购份额	45,956,689.71
减:报告期基金总赎回份额	92,445,931.04
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,393,252,777.32

§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12月31日,博时基金公司共管理181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8638亿元人民币,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2439亿元人民币,累计分红逾916亿元人民币,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4季末:

博时固定收益类基金业绩表现亮眼。111只各类型债券基金中共有84只(各类份额分开计算)2018年全年收益率超过全市场债券平均收益率(4.55%),16只货币基金中共有10只(各类份额分开计算)2018年全年收益率超过全市场货币基金平均收益率(3.52%),在参与银河排名的107只固收产品(各类份额分开计算)中,有54只产品银河同类排名前1/2。债券型基金中,博时宏观回报债券A/B类、博时宏观回报债券C类2018年全年净值增长率均分别在200只、142只同类基金中排名第1,博时天颐债券A类2018年全年净值增长率在200只同类基金中排名第4,博时天颐债券C类2018年全年净值增长率均分别在200只、142只同类基金中排名第5,博时富华纯债债券、博时富瑞纯债债券、博时裕康纯债债券、博时双月薪定期支付债券2018年全年净值增长率排名均在银河同类前1/10,博时富发纯债债券、博时裕利纯债债券、博时富益纯债债券2018年全年净值增长率排名均在银河同类前1/8;货币型基金中,博时合惠货币B类、博时现金宝货币B类2018年全年净值增长率分别在291只同类基金中排名第8、第29,博时合惠货币A类2018年全年净值增长率在311只同类基金中排名第11。

博时旗下权益类基金业绩表现稳健。2018年A股市场震荡下行,博时旗下参与银河排名的83只权益产品(各类份额分开计算)中,56只银河同类排名在前1/2。其中,股票型基金里,博时工业4.0主题、博时丝路主题业绩排名均在银河同类前1/4;混合型基金中,博时乐臻定开混合2018年全年净值增长率在44只同类基金中均排名第4,博时新兴消费主题、博时汇智回报、博时新策略A类、博时新收益等基金业绩排名在银河同类前1/10,博时逆向投资、博时战略新兴产业、博时裕隆、博时鑫泰A类等基金业绩排名在银河同类前1/4;指数基金中,博时上证超大盘ETF及其联接基金等基金业绩排名在银河同类前1/10,博时上证50ETF及其联接基金A类业绩排名在银河同类前1/6,博时沪深300指数业绩排名在银河同类前1/3。

商品型基金当中,博时黄金ETF联接A类2018年全年净值增长率同类排名第1。

QDII基金方面,博时标普500ETF、博时标普500ETF联接A类2018年全年净值增长率银河同类排名均位于前1/3。

2、其他大事件

2018年12月28日,由新华网主办的第十一届"中国企业社会责任峰会"暨2018中国社会责任公益盛典在京隆重举行。凭借多年来对责任投资的始终倡导和企业公民义务的切实履行,老牌公募巨头博时基金在本次公益盛典上荣获"2018中国社会责任杰出企业奖"。

2018年12月22日,东方财富在南京举办的"2018东方财富风云榜暨基情20年"颁奖典礼上,博时基金喜获两项大奖,博时基金江向阳总经理获得"基情20周年最受尊敬行业领袖"奖;博时主题行业混合(LOF)荣登"天天基金年度产品热销榜"。

2018年12月21日, 由华夏时报社主办的"华夏机构投资者年会暨第十二届金蝉奖颁奖盛典"在北京召开,本次年会的主题是"金融业2019年:突破与回归",博时基金荣获"2018年度基金管理公司"。

2018年12月21日,由北京商报社、北京品牌协会主办的"科技赋能与金融生态再造"——2018年度(第四届)北京金融论坛在京成功举办,博时基金荣获"技术领先价值奖"。

2018年12月15日,第二届腾讯理财通金企鹅奖暨财富高峰论坛在深圳举行。会上揭晓了第二届金企鹅奖获奖名单,其中博时安盈债券基金(A类:000084、C类:000085)凭借年内出色的业绩表现以及在90后用户中的超高人气,一举斩获"最受90后用户喜爱的产品奖"。

2018年11月16日,由《每日经济新闻》主办的"2018公募基金高峰论坛暨金鼎奖颁奖典礼"在成都举行,凭借突出的资管实力和对价值投资的坚守,博时基金一举摘得"公募20年特别贡献奖——创造收益"这一重磅奖项,同时,旗下专户板块获"专户业务最具竞争力基金公司"奖。

2018年11月1日,博时基金正式加入联合国责任投资原则组织(简称UN PRI),成为中国较早加入UN PRI国际组织的资产管理机构之一。

2018年10月17日,由南方财经全媒体集团和21世纪传媒举办的21世纪国际财经峰会暨"金帆奖"评选在深圳举行,凭借对价值投资理念的坚守和出色的综合资管能力,博时基金一举斩获"2018年度基金管理公司金帆奖"这一重磅奖项。

§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亚洲票息收益债券型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时亚洲票息收益债券型证券投资基金合同》

9.1.3《博时亚洲票息收益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博时亚洲票息收益债券型证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6报告期内博时亚洲票息收益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
二〇一九年一月十九日

博时医疗保健行业混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年一月十九日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月18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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时医疗保健混合
基金主代码	050026
交易代码	050026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月28日
报告期末基金份额总额	369,350,348.55份
投资目标	本基金精选医疗保健行业的优质上市公司,在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为混合型基金。投资策略主要包括资产配置策略和个股选择策略两部分。其中,资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究,动态调整大类资产配置比例,以争取规避系统性风险。个股选择策略采用定性与定量相结合的方式,对医疗保健行业上市公司的投资价值进行综合评估,精选具有较强竞争优势的上市公司作为投资标的。
业绩比较基准	自本基金成立日至2015年3月15日,本基金的业绩比较基准为:申银万国医药生物行业指数收益率×95%+中国债券总指数收益率×5%;自2015年3月16日起本基金业绩比较基准变更为:中证医药卫生指数×80%+中债指数×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险/收益品种。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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(2018年10月1日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-50,404,232.83
2.本期利润	-71,256,737.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1932
4.期末基金资产净值	457,652,273.67
5.期末基金份额净值	1.239

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。

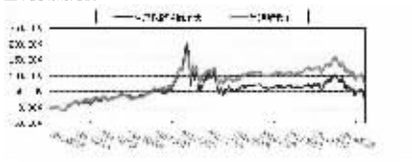
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	-13.60%	1.83%	-16.15%	1.52%	2.55%	0.31%

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		
葛晨	基金经理	2018-04-09	-	6.0	葛晨先生,硕士。2008年至2009年任大学生西部计划支西志愿者。2012年从南京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员、高级研究员兼基金经理助理。现任博时医疗保健行业混合型证券投资基金(2018年4月9日-至今)的基金经理。

注:上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,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

18年四季度医药板块大幅下跌,中证医药指数单季度下跌超过20%,尤其是4+7带量采购的结果公布后,部分仿制药品种超预期的降价引发了趋势性资金的流出乃至踩踏。我们在4+7结果出台前已经大幅降低了普通仿制药的配置比例,并加大了对创新药、高壁垒仿制药和可选医疗消费的配置;但在市场下跌过程中,环消息往往被不断放大,因此各种黑天鹅事件层出不穷,市场情绪变得极度悲观。此时我们跳出短期情绪的干扰可以清晰的看到:在老龄化趋势不断加速、健康意识不断提升的背景下,医疗健康的需求在确定性地持续上升;各类创新甚至革命性的医疗产品也在不断推陈出新;而从保障基础民生和全球横向比较来看,中国政府对医疗的投入不会降档。这些因素都奠定了医疗健康行业长期稳健发展的基础,前期恐慌性的整体杀跌恰恰给了投资者建仓这些优质标的最好时机,也往往是长期超额收益的重要来源。展望接下来一段时间,我们认为政府会在保民生强基层方面加大投入,各类原本高高在上、渗透率较低的产品可能会通过政府采购、医保谈判纳入等方式加速普及,因此适用于基层医疗机构的国产医疗设备、国产创新药等领域可能会有超额收益,我们将加大对该领域的配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,本基金基金份额净值为1.239元,份额累计净值为1.378元。报告期内,本基金基金份额净值增长率为-13.60%,同期业绩基准增长率-16.15%。

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	398,143,874.73	86.54
	其中:股票	398,143,874.73	86.54
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	34,500,000.00	7.50
	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	26,654,207.19	5.79
7	其他各项资产	756,969.27	0.16
8	合计	460,055,051.19	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	-	-
C	制造业	345,924,465.77	75.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	60,727.90	0.01
F	批发和零售业	22,170,535.26	4.84
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	50,145.80	0.01
K	房地产业	10,180,000.00	2.22
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	19,758,000.00	4.32
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	398,143,874.73	87.00

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	300760	迈瑞医疗	331,985	36,259,401.70	7.92
2	600276	恒瑞医药	649,460	34,259,015.00	7.49
3	000661	长春高新	163,635	28,636,125.00	6.26
4	600380	健康元	4,000,089	26,680,593.63	5.83
5	600161	天坛生物	1,149,924	24,435,885.00	5.34
6	002007	华兰生物	719,941	23,614,064.80	5.16
7	600085	同仁堂	812,100	22,332,750.00	4.88
8	300685	艾德生物	450,002	18,409,581.82	4.02
9	300595	欧普康视	397,893	15,414,374.82	3.37
10	600436	片仔癀	140,000	12,131,000.00	2.65

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

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	298,791.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	40,351.89
5	应收申购款	417,826.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	756,969.27

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

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。

§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12月31日,博时基金公司共管理181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8638亿元人民币,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2439亿元人民币,累计分红逾916亿元人民币,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4季末:

博时固定收益类基金业绩表现亮眼。111只各类型债券基金中共有84只(各类份额分开计算)2018年全年收益率超过全市场债券平均收益率(4.55%),16只货币基金中共有10只(各类份额分开计算)2018年全年收益率超过全市场货币基金平均收益率(3.52%),在参与银河排名的107只固收产品(各类份额分开计算)中,有54只产品银河同类排名前1/2。债券型基金中,博时宏观回报债券A/B类、博时宏观回报债券C类2018年全年净值增长率均分别在200只、142只同类基金中排名第1,博时天颐债券A类2018年全年净值增长率在200只同类基金中排名第4,博时天颐债券C类2018年全年净值增长率均分别在200只、142只同类基金中排名第5,博时富华纯债债券、博时富瑞纯债债券、博时裕康纯债债券、博时双月薪定期支付债券2018年全年净值增长率排名均在银河同类前1/10,博时富发纯债债券、博时裕利纯债债券、博时富益纯债债券2018年全年净值增长率排名均在银河同类前1/8;货币型基金中,博时合惠货币B类、博时现金宝货币B类2018年全年净值增长率分别在291只同类基金中排名第8、第29,博时合惠货币A类2018年全年净值增长率在311只同类基金中排名第11。

博时旗下权益类基金业绩表现稳健。2018年A股市场震荡下行,博时旗下参与银河排名的83只权益产品(各类份额分开计算)中,56只银河同类排名在前1/2。其中,股票型基金里,博时工业4.0主题、博时丝路主题业绩排名均在银河同类前1/4;混合型基金中,博时乐臻定开混合2018年全年净值增长率在44只同类基金中均排名第4,博时新兴消费主题、博时汇智回报、博时新策略A类、博时新收益等基金业绩排名在银河同类前1/10,博时逆向投资、博时战略新兴产业、博时裕隆、博时鑫泰A类等基金业绩排名在银河同类前1/4;指数基金中,博时上证超大盘ETF及其联接基金等基金业绩排名在银河同类前1/10,博时上证50ETF及其联接基金A类业绩排名在银河同类前1/6,博时沪深300指数业绩排名在银河同类前1/3。

商品型基金当中,博时黄金ETF联接A类2018年全年净值增长率同类排名第1。

QDII基金方面,博时标普500ETF、博时标普500ETF联接A类2018年全年净值增长率银河同类排名均位于前1/3。

2、其他大事件

2018年12月28日,由新华网主办的第十一届"中国企业社会责任峰会"暨2018中国社会责任公益盛典在京隆重举行。凭借多年来对责任投资的始终倡导和企业公民义务的切实履行,老牌公募巨头博时基金在本次公益盛典上荣获"2018中国社会责任杰出企业奖"。

2018年12月22日,东方财富在南京举办的"2018东方财富风云榜暨基情20年"颁奖典礼上,博时基金喜获两项大奖,博时基金江向阳总经理获得"基情20周年最受尊敬行业领袖"奖;博时主题行业混合(LOF)荣登"天天基金年度产品热销榜"。

2018年12月21日, 由华夏时报社主办的"华夏机构投资者年会暨第十二届金蝉奖颁奖盛典"在北京召开,本次年会的主题是"金融业2019年:突破与回归",博时基金荣获"2018年度基金管理公司"。

2018年12月21日,由北京商报社、北京品牌协会主办的"科技赋能与金融生态再造"——2018年度(第四届)北京金融论坛在京成功举办,博时基金荣获"技术领先价值奖"。

2018年12月15日,第二届腾讯理财通金企鹅奖暨财富高峰论坛在深圳举行。会上揭晓了第二届金企鹅奖获奖名单,其中博时安盈债券基金(A类:000084、C类:000085)凭借年内出色的业绩表现以及在90后用户中的超高人气,一举斩获"最受90后用户喜爱的产品奖"。

2018年11月16日,由《每日经济新闻》主办的"2018公募基金高峰论坛暨金鼎奖颁奖典礼"在成都举行,凭借突出的资管实力和对价值投资的坚守,博时基金一举摘得"公募20年特别贡献奖——创造收益"这一重磅奖项,同时,旗下专户板块获"专户业务最具竞争力基金公司"奖。

2018年11月1日,博时基金正式加入联合国责任投资原则组织(简称UN PRI)成为中国较早加入UN PRI国际组织的资产管理机构之一。

2018年10月17日,由南方财经全媒体集团和21世纪传媒举办的21世纪国际财经峰会暨"金帆奖"评选在深圳举行,凭借对价值投资理念的坚守和出色的综合资管能力,博时基金一举斩获"2018年度基金管理公司金帆奖"这一重磅奖项。

§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医疗保健行业混合型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时医疗保健行业混合型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时医疗保健行业混合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博时医疗保健行业混合型证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6报告期内博时医疗保