

博时月月盈短期理财债券型证券投资基金 更新招募说明书摘要 2018 年第 1 号

博时月月盈短期理财债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的发行已获中国证监会证监许可[2014]739 号文批准。自 2014 年 9 月 15 日至 2014 年 9 月 18 日通过销售机构公开发售。本基金为契约型开放式，存续期间为不定期。本基金的基金合同于 2014 年 9 月 22 日正式生效。

【重要提示】

本基金根据 2014 年 7 月 23 日中国证券监督管理委员会《关于核准博时月月盈短期理财债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2014]739 号）和 2014 年 8 月 25 日《关于博时月月盈短期理财债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》（证券基金机构监管部部函[2014]1154 号）准予募集注册。

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。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。

投资有风险，投资者认购（或集中申购）基金时应认真阅读本招募说明书，本基金投资于证券市场，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，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、市场风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险（详见招募说明书“风险揭示”章节）等等。

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。

本基金为采用固定组合策略的短期理财债券型基金，属于证券投资基金中较低风险、预期收益较为稳定的品种，其预期收益和预期的风险水平低于股票型基金、混合型基金和普通债券基金，高于货币市场基金。

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，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的过往业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2018年3月22日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年12月31日。

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： 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

办公地址： 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 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二十九个直属部门，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、特定资产管理部、多元资产管理部、年金投资部、绝对收益投资部、产品规划部、营销服务部、客户服务中心、市场部、养老金业务中心、战略客户部、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、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）、研究部。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。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、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。

市场部负责公司市场和销售管理、销售组织、目标和费用管理、销售督导与营销培训管理、公司零售渠道银行总行管理与维护、推动金融同业业务合作与拓展、国际业务的推动与协作等工作。战略客户部负责北方地区由国资委和财政部直接管辖企业以及该区域机构客户的销售与服务工作。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。零售-北京、零售-上海、零售-南方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。营销服务部负责营销策划、销售支持、品牌传播、对外媒体宣传等工作。

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相关工作。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。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相关工作。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相关工作。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。客户服务中心负责零售客户的服务和咨询工作。

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、上海分公司、沈阳分公司、郑州分公司和成都分公司，分别负责对驻京、沪、沈阳、郑州和成都人员日常行政管理和对赴京、沪、沈阳和郑州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 2018 年 3 月 31 日，公司总人数为 535 人，其中研究员和基金经理超过 87%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。

彭磊女士，分别于 1994 年 7 月及 2010 年 7 月获得西南财经大学企业管理专业经济学学士学位，以及北京大学金融学专业经济学硕士学位。曾在不同证券和金融类公司担任管理或行政职位，拥有相关管理和从业经验。于 2002 年 5 月至 2003 年 10 月兼任友联资

产管理公司执行董事。于 2002 年 5 月加入招商局金融集团有限公司，历任综合管理部副总经理、审计稽核部总经理、中国业务部总经理、证券部总经理、总经理助理。自 2011 年 6 月起担任长城证券股份有限公司董事；自 2015 年 3 月起担任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司董事；自 2016 年 4 月起担任招商局金融集团有限公司副总经理。

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，国信证券投行业务部副总经理，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。

张灏先生，1978 年生，学士。2000 年毕业于美国麻省理工学院，获得数学学士学位和经济学学士学位。2000 年起，任职于瑞士信贷（CSFB）纽约办公室并加入企业并购部门担任经理，负责全球电讯及消费零售行业的并购项目；2005 年，加入摩根大通（JP Morgan）香港办公室担任副总裁，负责大中华区的企业并购项目；2008 年，加入著名基金公司德劭集团（DE Shaw & Co.）之大中华区私募股权投资部门担任执行董事。2013 年至今，加入上海信利股权投资基金管理有限公司担任董事及上海汇华实业有限公司担任投资总监，并负责股权投资项目管理。

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

车晓昕女士，硕士，监事。1983 年起历任郑州航空工业管理学院助教、讲师、珠海证券有限公司经理、招商证券股份有限公司投资银行总部总经理。现任招商证券股份有限公司财务管理董事总经理。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。

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。现任公司总经理助理兼固定收益总部董事总经理、年金投资部总经理、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，主管 IT、运作、指数与量化投资等工作，博时基金（国际）有限公司及博时资本管理有限公司董事。

董良泓先生，CFA，MBA，副总经理。1993 年起先后在中国技术进出口总公司、中技上海投资公司、融通基金管理有限公司、长城基金管理有限公司从事投资管理工作。2005 年 2 月加入博时基金管理有限公司，历任社保股票基金经理，特定资产高级投资经理，研究部总

经理兼特定资产高级投资经理、社保股票基金经理、特定资产管理部总经理、博时资本管理有限公司董事。现任公司副总经理兼高级投资经理、社保组合投资经理，兼任博时基金（国际）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相关工作。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

魏桢女士，学士。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 天债券基金（2013.1.28-2015.9.11）、博时岁岁增利一年定期开放债券基金（2013.6.26-2016.4.25）、博时月月薪定期支付债券基金（2013.7.25-2016.4.25）、博时双月薪定期支付债券基金（2013.10.22-2016.4.25）、博时天天增利货币基金（2014.8.25-2017.4.26）、博时保证金货币 ETF 基金（2014.11.25-2017.4.26）、博时安盈债券基金（2015.5.22-2017.5.31）、博时产业债纯债基金（2016.5.25-2017.5.31）、博时安荣 18 个月定期开放债券基金（2015.11.24-2017.6.15）、博时聚享纯债债券基金（2016.12.19-2017.10.27）、博时安仁一年定开债基金（2016.6.24-2017.11.8）、博时裕鹏纯债债券基金（2016.12.22-2017.12.29）、博时安润 18 个月定开债基金（2016.5.20-2018.1.12）、博时安恒 18 个月定开债基金（2016.9.22-2018.4.2）的基金经理。现任固定收益总部现金管理组投资副总监兼博时安丰 18 个月定期开放债券（LOF）基金（2013.8.22-至今）、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金（2014.9.22-至今）、博时现金宝货币市场基金（2014.9.15-至今）、博时现金收益货币基金（2015.5.22-至今）、博时外服货币基金（2015.6.19-至今）、博时裕创纯债债券型证券投资基金（2016.5.13-至今）、博时裕盛纯

债债券基金（2016.5.20-至今）、博时合利货币基金（2016.8.3-至今）、博时合鑫货币基金（2016.10.12-至今）、博时安弘一年定开债基金（2016.11.15-至今）、博时合惠货币基金（2017.5.31-至今）、博时合晶货币基金（2017.8.2-至今）、博时丰庆纯债债券基金（2017.8.23-至今）、博时兴盛货币基金（2017.12.29-至今）的基金经理。

5、投资决策委员会成员

委员：江向阳、邵凯、黄健斌、李权胜、欧阳凡、魏凤春、王俊、过钧、白仲光

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。现任博时基金权益投资总部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。

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。现任特定资产管理部总经理兼社保组合投资经理。

魏凤春先生，经济学博士。1993 年起先后在山东经济学院、江南证券、清华大学、江南证券、中信建投证券公司工作。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（QDII-FOF）基金、博时平衡配置混合基金的基金经理。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。

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）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）、博时沪港深成长企业混合基金（2016.11.9-至今）、博时新兴消费主题混合基金（2017.6.5-至今）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（2005.8.24-2010.8.3）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）的基金经理。现任董事总经理兼固定收益总部公募基金组投资总监、博时信用债券投资基金（2009.6.10-至今）、博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）（2014.6.10-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）、博时新价值灵活配置混合型证券投资基金（2016.3.29-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）、博时双债增强债券型证券投资基金（2016.10.24-至今）、博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金（2017.1.10-至今）、博时鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金（2017.2.10-至今）、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金（2017.2.10-至今）、博时鑫和灵活配置混合型证券投资基金（2017.12.13-至今）的基金经理。

白仲光先生，博士。1991 年起先后在石家庄无线电九厂、石家庄经济学院、长盛基金、德邦基金、上海金珀资产管理公司工作。2015 年加入博时基金管理有限公司，曾任股票投资部绝对收益组投资总监，现任董事总经理兼绝对收益投资部总经理、年金投资部投资总监。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、 基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2017年12月31日，本集团总资产62,976.38亿元人民币，高级法下资本充足率15.48%，权重法下资本充足率12.66%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室，现有员工76人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系

统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获奖项国内托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7 月荣膺 2016 年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”；2017 年 6 月再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”，进一步扩大我行托管业务在国际资管和托管业界的影响力。

（二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014 年 7 月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013 年 5 月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生，本行副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991 年至 1995 年，在中国科技国际信托投资公司工作；1995 年 6 月至 2001 年 10 月，历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001 年 10 月至 2006 年 3 月，历任北京分行行长助理、副行长；2006 年 3 月至 2008 年 6 月，任北京分行党委书记、副行长（主持工作）；2008 年 6 月至 2012 年 6 月，任北京分行行长、党委书记；2012 年 6 月至 2013 年 11 月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013 年 11

月至 2014 年 12 月，任招商银行总行行长助理；2015 年 1 月起担任本行副行长；2016 年 11 月起兼任本行董事会秘书。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002 年 9 月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有 20 余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）基金托管业务经营情况

截至 2017 年 12 月 31 日，招商银行股份有限公司累计托管 335 只开放式基金。

三、 相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、直销机构

博时基金管理有限公司北京直销中心

名称：博时基金管理有限公司北京直销中心
 地址：北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层
 电话：010-65187055
 传真：010-65187032、010-65187592
 联系人：韩明亮
 博时一线通：95105568（免长途话费）

2、代销机构

(1) 中国银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址： | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |
| 办公地址： | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |
| 法定代表人： | 陈四清 |
| 联系人： | 高越 |
| 电话： | 010-66594973 |
| 客户服务电话： | 95566 |
| 网址： | http://www.boc.cn/ |

(2) 交通银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 上海市银城中路 188 号 |
| 办公地址: | 上海市银城中路 188 号 |
| 法定代表人: | 牛锡明 |
| 联系人: | 张宏革 |
| 电话: | 021-58781234 |
| 传真: | 021-58408483 |
| 客户服务电话: | 95559 |
| 网址: | http://www.bankcomm.com/ |

(3) 招商银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 深圳市福田区深南大道 7088 号 |
| 办公地址: | 深圳市福田区深南大道 7088 号 |
| 法定代表人: | 李建红 |
| 联系人: | 邓炯鹏 |
| 电话: | 0755-83198888 |
| 传真: | 0755-83195049 |
| 客户服务电话: | 95555 |
| 网址: | http://www.cmbchina.com/ |

(4) 中信银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座 |
| 办公地址: | 北京市东城区朝阳门北大街 9 号文化大厦 |
| 法定代表人: | 李庆萍 |
| 联系人: | 廉赵峰 |
| 传真: | 010-89937369 |
| 客户服务电话: | 95558 |
| 网址: | http://bank.ecitic.com/ |

(5) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

| | |
|--------|----------------|
| 注册地址: | 北京市西城区金融大街 3 号 |
| 办公地址: | 北京市西城区金融大街 3 号 |
| 法定代表人: | 李国华 |

| | |
|---------|---|
| 联系人: | 陈春林 |
| 传真: | 010-68858117 |
| 客户服务电话: | 95580 |
| 网址: | http://www.psbc.com |

(6)北京银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 北京市西城区金融大街甲 17 号首层 |
| 办公地址: | 北京市西城区金融大街丙 17 号 |
| 法定代表人: | 闫冰竹 |
| 联系人: | 孔超 |
| 传真: | 010-66226045 |
| 客户服务电话: | 95526 |
| 网址: | http://www.bankofbeijing.com.cn/ |

(7)平安银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 深圳市深南东路 5047 号 |
| 办公地址: | 深圳市深南东路 5047 号 |
| 法定代表人: | 谢永林 |
| 联系人: | 施艺帆 |
| 电话: | 021-50979384 |
| 传真: | 021-50979507 |
| 客户服务电话: | 95511-3 |
| 网址: | http://bank.pingan.com |

(8)上海农村商业银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼 |
| 办公地址: | 上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼 |
| 法定代表人: | 冀光恒 |
| 联系人: | 施传荣 |
| 电话: | 021-38576666 |
| 传真: | 021-50105124 |
| 客户服务电话: | 021-962999;4006962999 |
| 网址: | http://www.srcb.com/ |

(9) 浙商银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 浙江省杭州市庆春路 288 号 |
| 办公地址: | 浙江省杭州市庆春路 288 号 |
| 法定代表人: | 张达洋 |
| 联系人: | 毛真海 |
| 电话: | 0571-87659546 |
| 传真: | 0571-87659188 |
| 客户服务电话: | 95527 |
| 网址: | http://www.czbank.com |

(10) 深圳农村商业银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦 |
| 办公地址: | 广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦 |
| 法定代表人: | 李光安 |
| 联系人: | 常志勇 |
| 电话: | 0755-25188781 |
| 传真: | 0755-25188785 |
| 客户服务电话: | 961200, 4001961200 |
| 网址: | http://www.4001961200.com |

(11) 东莞农村商业银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号 |
| 办公地址: | 广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦 |
| 法定代表人: | 王耀球 |
| 联系人: | 杨亢 |
| 电话: | 0769-22866270 |
| 传真: | 0769-22866282 |
| 客户服务电话: | 961122 |
| 网址: | http://www.drcbank.com/ |

(12) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

| | |
|-------|---------------|
| 注册地址: | 常州市延陵中路 668 号 |
| 办公地址: | 常州市和平中路 413 号 |

| | |
|---------|---|
| 法定代表人: | 陆向阳 |
| 联系人: | 包静 |
| 电话: | 0519-89995066 |
| 传真: | 0519-89995170 |
| 客户服务电话: | 0519-96005 |
| 网址: | http://www.jnbank.cc |

(13) 富滇银行股份有限公司

| | |
|---------|--|
| 注册地址: | 云南省昆明市拓东路 41 号 |
| 办公地址: | 云南省昆明市拓东路 41 号 |
| 法定代表人: | 夏蜀 |
| 联系人: | 杨翊琳 |
| 电话: | 0871-63140324 |
| 传真: | 0871-63194471 |
| 客户服务电话: | 4008896533 |
| 网址: | www.fudian-bank.com |

(14) 上海天天基金销售有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层 |
| 办公地址: | 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼 |
| 法定代表人: | 其实 |
| 联系人: | 潘世友 |
| 电话: | 021-54509998 |
| 传真: | 021-64385308 |
| 客户服务电话: | 400-181-8188 |
| 网址: | http://www.1234567.com.cn |

(15) 上海好买基金销售有限公司

| | |
|---------|--------------------------------------|
| 注册地址: | 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室 |
| 办公地址: | 上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室 |
| 法定代表人: | 杨文斌 |
| 联系人: | 张茹 |
| 电话: | 021-20613610 |
| 客户服务电话: | 400-700-9665 |

| | |
|-----|---|
| 网址: | http://www.ehowbuy.com |
|-----|---|

(16) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室 |
| 办公地址: | 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼 |
| 法定代表人: | 陈柏青 |
| 联系人: | 朱晓超 |
| 电话: | 021-60897840 |
| 传真: | 0571-26697013 |
| 客户服务电话: | 400-076-6123 |
| 网址: | http://www.fund123.cn |

(17) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809 |
| 办公地址: | 北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 18 层 1809 |
| 法定代表人: | 戎兵 |
| 联系人: | 程刚 |
| 电话: | 010-52855713 |
| 传真: | 010-85894285 |
| 客户服务电话: | 400-609-9200 |
| 网址: | http://www.yixinfund.com |

(18) 和耕传承基金销售有限公司

| | |
|---------|--|
| 注册地址: | 郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦 602 |
| 办公地址: | 郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦 602 |
| 法定代表人: | 李淑慧 |
| 联系人: | 董亚芳 |
| 电话: | 0371-85518391 |
| 传真: | 0371-85518397 |
| 客户服务电话: | 400-360-0000 |
| 网址: | www.nicaifu.com |

(19) 大有期货有限公司

| | |
|-------|-------------------------------|
| 注册地址: | 湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段 128 号现代广场三、四楼 |
|-------|-------------------------------|

| | |
|---------|-------------------------------|
| 办公地址: | 湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段 128 号现代广场三、四楼 |
| 法定代表人: | 沈众辉 |
| 联系人: | 马科 |
| 电话: | 0731-84409000 |
| 传真: | 0731-84409009 |
| 客户服务电话: | 400-636-5058 |
| 网址: | www.dayouf.com |

(20) 龙江银行股份有限公司

| | |
|---------|----------------------|
| 注册地址: | 黑龙江省哈尔滨市道里区友谊路 436 号 |
| 办公地址: | 黑龙江省哈尔滨市道里区友谊路 436 号 |
| 法定代表人: | 张建辉 |
| 联系人: | 闫勇 |
| 电话: | 0451-85706107 |
| 传真: | 0451-85706107 |
| 客户服务电话: | 4006458888 |
| 网址: | www.lj-bank.com |

二、登记机构

名称: 博时基金管理有限公司
住所: 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层
办公地址: 北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层
法定代表人: 张光华
电话: 010-65171166
传真: 010-65187068
联系人: 许鹏

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：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

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：林佳璐

经办注册会计师：林佳璐、张振波

四、基金的名称

博时月月盈短期理财债券型证券投资基金

五、基金的类型

债券型

六、基金运作方式

本基金运作方式为契约型开放式，存续期间为不定期。

七、基金的投资目标

在谨慎投资的前提下，追求稳健的当期收益。

八、基金的投资范围

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括：现金、通知存款、银行定期存款和大额存单、债券回购、国债、政策性金融债、中央银行票据、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、企业债等债券，资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产。

未来若法律法规或监管机构允许基金投资同业存单及债券融资融券业务的,本基金可参与同业存单的投资以及债券的融资融券操作,并履行相应程序,具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

本基金将采用买入并持有策略,主要投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余运作期的固定收益类工具。

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

九、基金的投资策略

在运作期内,本基金将在坚持组合久期与运作期基本匹配的原则下,采用期限匹配、持有到期策略构建投资组合,基本保持大类品种配置的比例恒定。

本基金主要投资于利率市场化程度较高的货币市场工具,如:银行定期存款及大额存单、债券回购和短期债券(包括短期融资券、超短期融资券、即将到期的中期票据等)等。在运作期,根据市场情况和可投资品种的容量,在严谨深入的研究分析基础上,综合考量市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等,确定各类货币市场工具的配置比例,主要采取期限匹配、持有到期的投资策略。

十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:运作期起始日前的 Shibor-1M 五日平均值。

上海银行间同业拆放利率(Shanghai Interbank Offered Rate,简称 Shibor),以位于上海的全国银行间同业拆借中心为技术平台计算、发布并命名,是由信用等级较高的银行组成报价团自主报出的人民币同业拆出利率计算确定的算术平均利率,Shibor-1M 反映的是期限为 1 个月同业拆借利率水平。Shibor 较好的反映了货币市场的利率水平,是市场化产品的定价的基准之一。本产品选取运作期起始日前的 Shibor-1M 的五日均值作为业绩比较基准与本产品的投资标的和运作期期限相匹配。

如果今后法律法规发生变化,或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,并报中国

证监会备案。基金管理人应在调整前 2 个工作日在指定媒体上予以公告，而无需基金份额持有人大会审议。

十一、基金的风险收益特征

本基金为采用固定组合策略的短期理财债券型基金，属于证券投资基金中较低预期风险、预期收益较为稳定的品种，其预期的风险水平低于股票基金、混合基金和普通债券基金，高于货币市场基金。

十二、基金投资组合报告

博时基金管理公司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。

基金托管人根据基金合同规定，复核了本报告中的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 2017 年 12 月 31 日。

1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 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 | - | - |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 44,921,675.56 | 100.00 |
| 7 | 其他各项资产 | 1,751.90 | 0.00 |
| 8 | 合计 | 44,923,427.46 | 100.00 |

2 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 | - | |
| | 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

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%

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 | - |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 31 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 0 |

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

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 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投资。

6 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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 |
| 报告期内偏离度的最高值 | - |

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

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

无。

8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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投资。

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 1.00 元。

9.2 报告期内本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。

9.3 期末其他各项资产构成

| 单位：人民币元 | | |
|---------|---------|----------|
| 序号 | 名称 | 金额 |
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 1,751.90 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,751.90 |

9.4 其他需说明的重要事项

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

1. 博时月月盈短期理财债券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 |
|----------------------------------|---------|-----------|------------|---------------|----------|---------|
| 2014.9.22-2014.10.20 (第一期运作期) | 0.3203% | 0.0026% | 0.3269% | 0.0000% | -0.0066% | 0.0026% |
| 2016.12.27-2016.12.31 | - | - | - | - | - | - |
| 2017.1.1-2017.12.31 | 0.9244% | 0.0022% | 1.0579% | 0.0009% | -0.1335% | 0.0013% |
| 2014.9.22-2017.12.31 | 1.2671% | 0.0024% | 1.3848% | 0.0008% | -0.1177% | 0.0016% |

注：本基金第二期运作期为自 2016 年 12 月 27 日起至 2017 年 1 月 23 日止，且仅开放 R 类。本基金第三期运作期为自 2017 年 1 月 24 日起至 2017 年 2 月 20 日止，且仅开放 R 类。本基金第四期运作期为自 2017 年 3 月 21 日起至 2017 年 4 月 20 日止，且仅开放 R 类。本基金第五期运作期为自 2017 年 4 月 21 日起至 2017 年 5 月 22 日止。本基金第六期运作期为自 2017 年 5 月 23 日起至 2017 年 6 月 20 日止。本基金第七期运作期为自 2017 年 6 月 21 日起至 2017 年 7 月 20 日止。各期间数据仅统计该期间的实际有效运作期。

2. 博时月月盈短期理财债券R:

| 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 |
|----------------------------------|---------|-----------|------------|---------------|----------|---------|
| 2014.9.22-2014.10.20 (第一期运作期) | 0.3203% | 0.0026% | 0.3269% | 0.0000% | -0.0066% | 0.0026% |
| 2016.12.27-2016.12.31 | 0.0511% | 0.0064% | 0.0442% | 0.0000% | 0.0069% | 0.0064% |
| 2017.1.1-2017.12.31 | 1.8300% | 0.0029% | 1.9116% | 0.0011% | -0.0816% | 0.0018% |
| 2014.9.22-2017.12.31 | 2.2280% | 0.0030% | 2.2829% | 0.0011% | -0.0549% | 0.0019% |

注：本基金第二期运作期为自 2016 年 12 月 27 日起至 2017 年 1 月 23 日止，且仅开放 R 类。本基金第三期运作期为自 2017 年 1 月 24 日起至 2017 年 2 月 20 日止，且仅开放 R 类。本基金第四期运作期为自 2017 年 3 月 21 日起至 2017 年 4 月 20 日止，且仅开放 R 类。本基金第五期运作期为自 2017 年 4 月 21 日起至 2017 年 5 月 22 日止。本基金第六期运作期为自 2017 年 5 月 23 日起至 2017 年 6 月 20 日止。本基金第七期运作期为自 2017 年 6 月 21 日起至 2017 年 7 月 20 日止。各期间数据仅统计该期间的实际有效运作期。

十四、基金的费用与税收

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、基金的销售服务费；
- 4、基金财产划拨支付的银行费用；
- 5、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、基金的开户费用；
- 10、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

二、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

三、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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

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前 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

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.08%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

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前 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 A 类基金份额和 R 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%

在通常情况下，销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日基金资产净值

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前 3 个工作日内从基金财产中一次性划出，经登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

4、**证券账户开户费用：**证券账户开户费由基金托管人在开户时先行垫付，基金在证券账户开户后一个月内成立的，自证券账户开户后一个月内由基金托管人从基金财产中扣划；如证券账户开户后一个月内基金未能成立，由基金管理人在收到基金托管人缴费通知后的 5 个工作日内支付给基金托管人，基金托管人不承担垫付开户费用义务。

5、除管理费、托管费和销售服务费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

四、不列入基金费用的项目

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。

五、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调低基金管理费率、基金托管费率和基金销售服务费。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

六、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于 2017 年 11 月 6 日刊登的本基金原招募说明书（〈博时月月盈短期理财债券型证券投资基金招募说明书〉）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“一、绪言”中，对招募说明书依照的法律进行了更新；
- 2、在“二、释义”中，更新了 13 至 59 条释义；
- 3、在“三、基金管理人”中，对基金管理人的基本情况进行了更新；
- 4、在“四、基金托管人”中，对基金托管人的基本情况进行了更新；
- 5、在“五、相关服务机构”中，对直销机构、代销机构和审计会计师事务所的相关信息进行了更新；
- 6、在“九、基金份额的申购与赎回”中，更新了“（五）集中申购与赎回的数额限制”、“（六）申购费率、赎回费率”、“（七）集中申购份额与赎回金额的计算”、“（九）拒绝或暂停申购的情形及处理”、“（十）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”的内容
- 7、在“十、基金的投资”中，更新了“（七）投资限制”、“（十）基金投资组合报告”的内容，数据内容截止时间为 2017 年 12 月 31 日；
- 8、在“十一、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 2017 年 12 月 31 日；
- 9、在“十三、基金资产的估值”中，更新了“（六）暂停估值的情形”的内容；
- 10、在“十七、基金的信息披露”中，更新了“（六）基金定期报告”、“（七）临时报告”的内容；
- 11、在“十八、风险揭示”中，更新了“（三）本基金特有的风险”的内容；
- 12、在“二十一、基金托管协议的内容摘要”中，更新了“（一）托管协议当事人”、“（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查”的内容；
- 13、在“二十三、其它应披露的事项”中根据最新情况对相关应披露事项进行了更新。
（一）、2017年12月06日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了

《关于博时旗下部分开放式基金增加龙江银行股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》；

(二)、2017年11月06日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时月月盈短期理财债券型证券投资基金招募说明书2017年第2号(摘要)》；

(三)、2017年10月27日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时月月盈短期理财债券型证券投资基金2017年第3季度报告》；

博时基金管理有限公司

2018年5月5日