

博时信用债券投资基金

「2012」 第一季度报告

使基金的投资组合比例符合本基金合同第一部分“四”投资策略、“五”投资限制”的有关规定。本基金建仓结束后各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1基金经理 或基金经理小组简介				
姓名	在本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明	
姓名	任职日期	离任日期		
过约	固定收益部副经理/基金经理	2009-6-10	-	12

4.2报告期内本基金运作遵守情况说明
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、《博时信用债券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、受托于市场、受托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,基金管理人在规定时间内进行了调整,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,本基金管理人未发现异常交易行为。

4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析
2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

2季度,欧洲债务危机出现反复,国内经济下行压力逐步加大,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。中期利率下行,央行降准与降息同时使用,债市利率阶段性走低,短期利率下行,中长期利率受债券调整幅度较小,信用市场受信贷支持,信用债收益率大幅下降。

5.2报告期内未按行业分类的股票投资组合

序号	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	74,715.00	0.01	
C0 食品、饮料	-	-	-
C1 纺织、服装、皮毛	56,200.00	0.01	
C2 木材、家具	-	-	-
C3 造纸、印刷	-	-	-
C4 石油、化学、塑胶、塑料	9,595.00	0.00	
C5 电子	8,920.00	0.00	
C6 金属、非金属	-	-	-
C7 机械、设备、仪表	-	-	-
C8 医药、生物制品	-	-	-
C99 其他制造业	-	-	-
D 电力、煤气及水的生产和供应业	71,765,279.11	7.68	
E 建筑业	-	-	-
F 交通运输、仓储业	79,029,291.60	8.46	
G 批发和零售贸易	-	-	-
H 信息技术业	-	-	-
I 金融、保险业	35,417,024.00	3.79	
J 房地产业	-	-	-
K 社会服务业	-	-	-
L 传播与文化产业	-	-	-
M 综合类	-	-	-
合计	186,286,309.71	19.93	

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10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	601006	大秦铁路	11,241,720	79,029,291.60	8.46
2	601601	中国太保	1,596,800	35,417,024.00	3.79
3	000101	华能国际	3,231,891	20,845,696.95	2.23
4	600886	国投电力	3,880,016	16,839,264.44	1.80
5	000539	粤电力A	1,969,429	12,998,231.40	1.39
6	600027	华电国际	2,561,768	10,733,807.92	1.15
7	600795	国电电力	3,000,000	8,100,000.00	0.87
8	600098	广州控股	324,895	2,248,273.40	0.24
9	601339	广汽东方	5,000	56,200.00	0.01
10	300320	海达股份	500	9,595.00	0.00

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	102,850,000.00	11.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	248,175,000.00	26.55
4	企业债、中期票据	248,175,000.00	26.55
5	企业短期融资券	340,140,594.00	36.53
6	中期票据	-	-
7	可转债	597,781,351.20	63.96
8	其他	-	-
合计	1,278,946,945.20	136.84	

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10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	113001	中行转债	4,044,720	392,823,206.40	42.03
2	123038	12进债C08	2,500,000	248,175,000.00	26.55
3	110018	国电转债	736,000	82,777,920.00	8.86
4	110013	国投转债	725,160	77,925,693.60	8.34
5	091918	11国债18	600,000	60,066,000.00	6.43

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10名资产支持证券投资明细
本基金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5名权证投资明细
本基金报告期末未持有权证。

5.8.1投资组合报告附注
5.8.1.1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

5.8.1.2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

5.8.1.3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

5.8.1.4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

5.8.1.5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

5.8.1.6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

5.8.1.7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

5.8.1.8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

5.8.1.9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

5.8.1.10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

5.8.1.11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

5.8.1.12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

5.8.1.13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

5.8.1.14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

5.8.1.15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

5.8.1.16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

5.8.1.17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

5.8.1.18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

5.8.1.19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

5.8.1.20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

5.8.1.21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

5.8.1.22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

5.8.1.23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

5.8.1.24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

5.8.1.25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

5.8.1.26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

5.8.1.27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

5.8.1.28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

5.8.1.29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

5.8.1.30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。

5.8.2.2基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定股票库之外的股票。

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	486,173.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	145,435.10
4	应收利息	12,371,915.94
5	应收申购款	1,380,237.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,383,761.87

5.8.4.4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	113001	中行转债	392,823,206.40	42.03
2	110018	国电转债	82,777,920.00	8.86
3	110013	国投转债	77,925,693.60	8.34
4	110016	川投转债	44,254,531.20	4.73

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.6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

项目	博时信用债券 A/B	博时信用债券 C
本报告期初基金份额总额	497,786,234.49	420,907,630.78
本报告期基金总申购份额	168,012,971.23	111,496,691.50
减:本报告期基金总赎回份额	195,587,430.40	99,549,489.35
本报告期基金净申购/赎回份额	-	-
本报告期末基金份额总额	470,211,775.32	432,854,832.93