

博时裕盈纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月二十二日

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月19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,也不保证基金份额持有人权益不受损失,投资者投资于本基金,可能会面临本金损失的风险。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

2 基金基本情况

基金名称	博时裕盈纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金
基金代码	010020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年03月30日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2019年1月1日至2019年3月31日)
1.本期已实现收益	42,691,693.33
2.本期利润	60,001,000.32
3.本期基金份额持有人应得利润	59,999,999.99
4.期末基金份额净值	1.0000, 200,000.00
5.期末基金资产净值	1,980,490,203.27
6.期末基金份额持有人数量	1,000

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,计入费用后投资者的实际收益率可能低于所列数字。

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	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	净值增长率偏离度④	①-③	②-④
过去三个月	1.63%	0.04%	1.00%	0.07%	0.05%	-0.01%

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



注:上述指标按日期、权重和日期权重基金管理人对外披露的无风险利率计算。证券市场的含义遵从行业协会《证券从业人员职业道德管理办法》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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他各项法律法规、基金合同和中国证监会的相关规定,并未发生任何违法违规行为,也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金法》和《证券投资基金管理条例》的相关规定,不存在任何违法违规行为,也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易专项说明

4.3.2 公平交易专项说明

4.3.3 公平交易专项说明

4.3.4 公平交易专项说明

4.3.5 公平交易专项说明

4.3.6 公平交易专项说明

4.3.7 公平交易专项说明

4.3.8 公平交易专项说明

4.3.9 公平交易专项说明

4.3.10 公平交易专项说明

4.3.11 公平交易专项说明

4.3.12 公平交易专项说明

4.3.13 公平交易专项说明

4.3.14 公平交易专项说明

4.3.15 公平交易专项说明

4.3.16 公平交易专项说明

4.3.17 公平交易专项说明

4.3.18 公平交易专项说明

4.3.19 公平交易专项说明

4.3.20 公平交易专项说明

4.3.21 公平交易专项说明

4.3.22 公平交易专项说明

4.3.23 公平交易专项说明

4.3.24 公平交易专项说明

4.3.25 公平交易专项说明

4.3.26 公平交易专项说明

4.3.27 公平交易专项说明

4.3.28 公平交易专项说明

4.3.29 公平交易专项说明

4.3.30 公平交易专项说明

4.3.31 公平交易专项说明

4.3.32 公平交易专项说明

4.3.33 公平交易专项说明

4.3.34 公平交易专项说明

4.3.35 公平交易专项说明

4.3.36 公平交易专项说明

4.3.37 公平交易专项说明

4.3.38 公平交易专项说明

4.3.39 公平交易专项说明

4.3.40 公平交易专项说明

4.3.41 公平交易专项说明

4.3.42 公平交易专项说明

4.3.43 公平交易专项说明

4.3.44 公平交易专项说明

4.3.45 公平交易专项说明

4.3.46 公平交易专项说明

4.3.47 公平交易专项说明

4.3.48 公平交易专项说明

4.3.49 公平交易专项说明

4.3.50 公平交易专项说明

4.3.51 公平交易专项说明

4.3.52 公平交易专项说明

4.3.53 公平交易专项说明

4.3.54 公平交易专项说明

4.3.55 公平交易专项说明

4.3.56 公平交易专项说明

4.3.57 公平交易专项说明

4.3.58 公平交易专项说明

4.3.59 公平交易专项说明

4.3.60 公平交易专项说明

4.3.61 公平交易专项说明

4.3.62 公平交易专项说明

4.3.63 公平交易专项说明

4.3 异常交易行为的专项说明

4.3.1 异常交易行为的专项说明

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.3.4 异常交易行为的专项说明

4.3.5 异常交易行为的专项说明

4.3.6 异常交易行为的专项说明

4.3.7 异常交易行为的专项说明

4.3.8 异常交易行为的专项说明

4.3.9 异常交易行为的专项说明

4.3.10 异常交易行为的专项说明

4.3.11 异常交易行为的专项说明

4.3.12 异常交易行为的专项说明

4.3.13 异常交易行为的专项说明

4.3.14 异常交易行为的专项说明

4.3.15 异常交易行为的专项说明

4.3.16 异常交易行为的专项说明

4.3.17 异常交易行为的专项说明

4.3.18 异常交易行为的专项说明

4.3.19 异常交易行为的专项说明

4.3.20 异常交易行为的专项说明

4.3.21 异常交易行为的专项说明

4.3.22 异常交易行为的专项说明

4.3.23 异常交易行为的专项说明

4.3.24 异常交易行为的专项说明

4.3.25 异常交易行为的专项说明

4.3.26 异常交易行为的专项说明

4.3.27 异常交易行为的专项说明

4.3.28 异常交易行为的专项说明

4.3.29 异常交易行为的专项说明

4.3.30 异常交易行为的专项说明

4.3.31 异常交易行为的专项说明

4.3.32 异常交易行为的专项说明

4.3.33 异常交易行为的专项说明

4.3.34 异常交易行为的专项说明

4.3.35 异常交易行为的专项说明

4.3.36 异常交易行为的专项说明

4.3.37 异常交易行为的专项说明

4.3.38 异常交易行为的专项说明

4.3.39 异常交易行为的专项说明

4.3.40 异常交易行为的专项说明

4.3.41 异常交易行为的专项说明

4.3.42 异常交易行为的专项说明

4.3.43 异常交易行为的专项说明

4.3.44 异常交易行为的专项说明

4.3.45 异常交易行为的专项说明

4.3.46 异常交易行为的专项说明

4.3.47 异常交易行为的专项说明

4.3.48 异常交易行为的专项说明

4.3.49 异常交易行为的专项说明

4.3.50 异常交易行为的专项说明

4.3.51 异常交易行为的专项说明

4.3.52 异常交易行为的专项说明

4.3.53 异常交易行为的专项说明

4.3.54 异常交易行为的专项说明

4.3.55 异常交易行为的专项说明

4.3.56 异常交易行为的专项说明

4.3.57 异常交易行为的专项说明

4.3.58 异常交易行为的专项说明

4.3.59 异常交易行为的专项说明

4.3.60 异常交易行为的专项说明

4.3.61 异常交易行为的专项说明

4.3.62 异常交易行为的专项说明

4.3.63 异常交易行为的专项说明

4.3.64 异常交易行为的专项说明

4.3.65 异常交易行为的专项说明

4.3.66 异常交易行为的专项说明

4.3.67 异常交易行为的专项说明

4.3.68 异常交易行为的专项说明

4.3.69 异常交易行为的专项说明

4.3.70 异常交易行为的专项说明

4.3.71 异常交易行为的专项说明

4.3.72 异常交易行为的专项说明

4.3.73 异常交易行为的专项说明

4.3.74 异常交易行为的专项说明

4.3.75 异常交易行为的专项说明

4.3.76 异常交易行为的专项说明

4.3.77 异常交易行为的专项说明

4.3.78 异常交易行为的专项说明

4.3.79 异常交易行为的专项说明

4.3.80 异常交易行为的专项说明

4.3.81 异常交易行为的专项说明

4.3.82 异常交易行为的专项说明

4.3.83 异常交易行为的专项说明

4.3.84 异常交易行为的专项说明

4.3.85 异常交易行为的专项说明

4.3.86 异常交易行为的专项说明

4.3.87 异常交易行为的专项说明

4.3.88 异常交易行为的专项说明

4.3.89 异常交易行为的专项说明

4.3.90 异常交易行为的专项说明

4.6 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明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	142031	保利地产	1,000,000.00	38,000,000.00	1.95
2	121001	浦发银行	500,000.00	19,000,000.00	0.98

注:本基金本报告期末持有资产支持证券,公允价值为38,000,000.00元,占基金资产净值的比例为1.95%。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	130001	13国债01	200,000,000.00	10.10
2	130002	13国债02	180,000,000.00	9.10
3	130003	13国债03	160,000,000.00	8.10
4	130004	13国债04	140,000,000.00	7.10
5	130005	13国债05	120,000,000.00	6.10

4.10 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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

4.11 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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

4.12 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期权投资明细

本基金本报告期末未持有期权。

4.13 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。

4.14 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末持有资产支持证券,公允价值为38,000,000.00元,占基金资产净值的比例为1.95%。

4.15 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。

4.16 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。

4.17 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。

4.18 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。

4.19 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。

4.20 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。

4.21 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。

4.22 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。

4.23 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。

4.24 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。

4.25 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