

博时裕荣纯债债券型证券投资基金

2016 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:上海银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十二日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、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。

基金管理人上海银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2016年4月21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2016年1月1日起至3月31日止。

2 基金产品概况
基金名称:博时裕荣纯债债券型证券投资基金
基金代码:001903

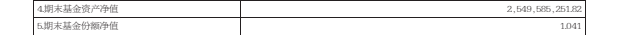
Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期(2016年1月1日至2016年3月31日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金份额净值, 5.期末基金资产净值, 6.期末基金份额持有人数.

3.1 主要财务指标
注:本基金合同于2015年11月6日生效,按照本基金的基金合同约定,自基金合同生效之日起6个月内,本基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“(二)投资范围”、“(四)投资限制”的有关约定。

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

注:本基金合同于2015年11月6日生效,按照本基金的基金合同约定,自基金合同生效之日起6个月内,本基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“(二)投资范围”、“(四)投资限制”的有关约定。

3.2.2 本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:本基金合同于2015年11月6日生效,按照本基金的基金合同约定,自基金合同生效之日起6个月内,本基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“(二)投资范围”、“(四)投资限制”的有关约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 职务: 博时裕荣纯债债券型证券投资基金基金经理

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,本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同和基金托管协议的约定,勤勉尽责,取信于市场,恪守信誉,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析
2016年第一季度,在财政政策稳增长为主导下,经济金融数据超预期增长,货币政策维持中性对冲,以“利率走通”的价格调控方式稳定货币市场预期。

4.5 报告期内本基金的业绩表现
截至2016年3月31日,本基金份额净值为1.041元,累计份额净值为1.041元,报告期内净值增长率为30.2%,同期业绩比较基准收益率为0.67%。

4.6 报告期内本基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况
4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing portfolio composition at the end of the reporting period, including 1. 权益投资, 2. 固定收益投资, 3. 金融衍生品投资, 4. 买入返售金融资产, 5. 其他资产, 6. 负债.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
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

Table showing top 10 stocks held by the fund at the end of the reporting period, including 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing bond portfolio composition at the end of the reporting period, including 序号, 债券品种, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table showing top 5 bonds held by the fund at the end of the reporting period, including 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(%)

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

Table showing top 10 asset-backed securities held by the fund at the end of the reporting period, including 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(%)

5.7 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table showing convertible bonds held by the fund at the end of the reporting period, including 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(%)

5.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券公允价值变动超过净资产0.5%以上的明细

Table showing convertible bonds with significant value changes at the end of the reporting period, including 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(%)

5.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.12 投资组合报告附注
5.13 其他各项资产构成

6 开放式基金资产变动情况
6.1 基金资产变动情况

Table showing changes in open-ended fund assets, including 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

6.2 基金份额持有人户数、基金份额结构情况统计

Table showing statistics on the number of fund shareholders and share structure, including 序号, 项目, 户数, 基金份额(万份), 占基金份额总额比例(%)

6.3 基金资产净值、基金份额净值

Table showing fund assets and net asset value, including 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

6.4 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.5 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.6 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.7 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.8 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.9 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.10 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.11 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.12 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.13 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.14 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.15 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.16 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.17 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.18 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.19 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.20 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.21 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.22 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.23 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.24 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.25 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.26 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.27 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.28 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.29 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.30 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.31 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.32 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.33 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.34 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.35 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

博时裕瑞纯债债券型证券投资基金

2016 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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十二日

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、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。

基金管理人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2016年4月21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2016年1月1日起至3月31日止。

2 基金产品概况
基金名称:博时裕瑞纯债债券型证券投资基金
基金代码:001904

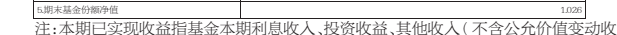
Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期(2016年1月1日至2016年3月31日). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期利润, 3.加权平均基金份额本期利润, 4.期末基金份额净值, 5.期末基金资产净值, 6.期末基金份额持有人数.

3.1 主要财务指标
注:本基金合同于2015年6月30日生效,按照本基金的基金合同约定,自基金合同生效之日起6个月内,本基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“(二)投资范围”、“(四)投资限制”的有关约定。

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

注:本基金合同于2015年6月30日生效,按照本基金的基金合同约定,自基金合同生效之日起6个月内,本基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“(二)投资范围”、“(四)投资限制”的有关约定。

3.2.2 本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:本基金合同于2015年6月30日生效,按照本基金的基金合同约定,自基金合同生效之日起6个月内,本基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“(二)投资范围”、“(四)投资限制”的有关约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 职务: 博时裕瑞纯债债券型证券投资基金基金经理

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,本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同和基金托管协议的约定,勤勉尽责,取信于市场,恪守信誉,切实维护基金份额持有人的合法权益。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析
2016年第一季度,在财政政策稳增长为主导下,经济金融数据超预期增长,货币政策维持中性对冲,以“利率走通”的价格调控方式稳定货币市场预期。

4.5 报告期内本基金的业绩表现
截至2016年3月31日,本基金份额净值为1.026元,累计份额净值为1.026元,报告期内净值增长率为1.07%,同期业绩比较基准收益率为0.67%。

4.6 报告期内本基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing portfolio composition at the end of the reporting period, including 1. 权益投资, 2. 固定收益投资, 3. 金融衍生品投资, 4. 买入返售金融资产, 5. 其他资产, 6. 负债.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table showing top 10 stocks held by the fund at the end of the reporting period, including 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(%)

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

Table showing top 10 stocks held by the fund at the end of the reporting period, including 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing bond portfolio composition at the end of the reporting period, including 序号, 债券品种, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table showing top 5 bonds held by the fund at the end of the reporting period, including 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(%)

5.6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table showing convertible bonds held by the fund at the end of the reporting period, including 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(%)

5.7 报告期末持有的处于转股期的可转换债券公允价值变动超过净资产0.5%以上的明细

Table showing convertible bonds with significant value changes at the end of the reporting period, including 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(%)

5.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注
5.12 其他各项资产构成

Table showing changes in open-ended fund assets, including 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

6.2 基金份额持有人户数、基金份额结构情况统计

Table showing statistics on the number of fund shareholders and share structure, including 序号, 项目, 户数, 基金份额(万份), 占基金份额总额比例(%)

6.3 基金资产净值、基金份额净值

Table showing fund assets and net asset value, including 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

6.4 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.5 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.6 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.7 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.8 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.9 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.10 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.11 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.12 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.13 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.14 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.15 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.16 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.17 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.18 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.19 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.20 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.21 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.22 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.23 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.24 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.25 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.26 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.27 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.28 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.29 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.30 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.31 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.32 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.33 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

6.34 基金管理人及基金销售机构履行投资者适当性义务的情况

6.35 基金投资资产支持证券的情况

Table showing investment in asset-backed securities, including 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(%)

Table showing portfolio composition at the end of the reporting period, including 序号, 债券品种, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table showing top 5 bonds held by the fund at the end of the reporting period, including 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(%)

Table showing top 10 asset-backed securities held by the fund at the end of the reporting period, including 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(%)

Table showing convertible bonds held by the fund at the end of the reporting period, including 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(%)

Table showing convertible bonds with significant value changes at the end of the reporting period, including 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(%)

Table showing top 10 stocks held by the fund at the end of the reporting period, including 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(%)

Table showing top 10 stocks held by the fund at the end of the reporting period, including 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(%)

Table showing top 5 bonds held by the fund at the end of the reporting period, including 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(%)

Table showing top 10 asset-backed securities held by the fund at the end of the reporting period, including 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(%)

Table showing convertible bonds held by the fund at the end of the reporting period, including 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(%)

Table showing convertible bonds with significant value changes at the end of the reporting period, including 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(%)

Table showing top 10 stocks held by the fund at the end of the reporting period, including 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元