博时保泽保本混合型证券投资基金

【2017】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:二〇一七年四月二十二日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时保泽保本
基金主代码	002530
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年4月7日
报告期末基金份额总额	2,734,232,159.17份
投资目标	在保障保本周期到期时本金安全的前提下,严格控制风险,追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合,利用组合保险技术,动态调整固定收益类资产与风险资产的投资比例,以确保基金在保本周期到期时,实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。
业绩比较基准	二年期银行定期存款收益率(税后)
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。
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
基金保证人	北京首创融资担保有限公司
下属分级基金的基金简称	博时保泽保本A / 博时保泽保本C
下属分级基金的交易代码	002530 / 002531
报告期末下属分级基金的份额总额	2,417,115,584.03份 / 317,116,575.14份

§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(2017年1月1日-2017年3月31日)	
	博时保泽保本A	博时保泽保本C
1.本期已实现收益	-5,454,167.40	-1,032,128.21
2.本期利润	22,496,784.04	2,751,751.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0092	0.0082
4.期末基金资产净值	2,438,726,124.58	318,672,947.84
5.期末基金份额净值	1.009	1.005

注:本基金合同生效日为2016年4月7日。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

1. 博时保泽保本A:

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	0.90%	0.06%	0.52%	0.01%	0.38%	0.05%

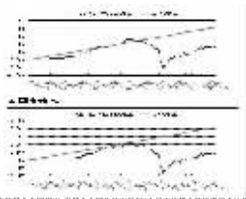
2. 博时保泽保本C:

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	0.80%	0.05%	0.52%	0.01%	0.28%	0.04%

注:本基金合同于2016年4月7日生效,本基金的业绩比较基准为:二年期银行定期存款收益率(税后)。

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

1. 博时保泽保本A:



注:本基金合同于2016年4月7日生效。按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基合同第十二部分"(二)投资范围"、"(四)投资限制"的有关约定。本基金建仓期结束时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	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		
孙少锋	基金经理	2016-04-07	-	9.4	2004年起先后在东方航空财务公司、华为技术公司、招商基金工作。2015年加入博时基金管理有限公司,曾任投资经理,现任博时策略灵活配置混合型证券投资基金、博时瑞源保本混合型证券投资基金、博时保泽保本混合型证券投资基金、博时保泽保本混合型证券投资基金、博时丰保本混合型证券投资基金、博时保泰保本混合型证券投资基金的基金经理。
杨永光	股票投资部绝对收益组投资副总监/基金经理	2016-04-07	-	15.5	1993年至1997年先后在桂林电器科学研究所、民间迈瑞生物医疗电子股份公司工作。2001年起在国海证券历任债券研究员、债券投资经理助理、高级投资经理、投资主办人。2011年加入博时基金管理有限公司,历任博时稳定价值债券基金、上证企债30ETF基金、博时天颐债券基金、博时招财一号保本基金、博时新机遇混合基金的基金经理、固定收益总部公募基金组投资副总监。现任股票投资部绝对收益组投资副总监兼博时优势收益信用债债券基金、博时瑞源保本混合基金、博时保泽保本混合基金、博时保泽保本混合基金、博时保丰保本混合基金、博时保泰保本混合基金、博时保泰保本混合基金、博时招财二号保本基金、博时富宁纯债债券基金、博时富益纯债债券基金、博时臻选纯债债券基金、博时富华纯债债券基金、博时泰安债券基金、博时鑫丰混合基金、博时鑫泰混合基金、博时鑫惠混合基金、博时聚赢纯债债券基金、博时广利纯债债券基金、博时富瑞纯债债券基金、博时富海纯债债券基金、博时华盛纯债债券基金的基金经理。

4.2 管理人对投资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

报告期内,市场整体反弹,主要指数均有一定涨幅。我们在一季度适度增加了仓位,并以价值和合理成长为基本配置,特别侧重于参与了价值股的投资机会。我们认为,一季度过后,市场风险逐渐增加,因此二季度将控制仓位,以精选个股为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年3月31日,本基金A类基金份额净值为1.009元,份额累计净值为1.009元;C类基金份额净值为1.005元,份额累计净值为1.005元。报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为0.90%,C类基金份额净值增长率为0.80%,同期业绩基准增长率0.52%。

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	152,147,251.39	5.50
	其中:股票	152,147,251.39	5.50
2	固定收益投资	2,046,341,181.20	73.96
	其中:债券	2,046,341,181.20	73.96
	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	52,000,000.00	1.88
	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	480,974,246.62	17.38
7	其他各项资产	35,707,384.07	1.29
8	合计	2,767,170,063.28	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	11,804,763.00	0.43
C	制造业	96,423,172.48	3.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	160,331.21	0.01
E	建筑业	1,906,834.50	0.07
F	批发和零售业	560,278.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	3,152,213.58	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,827,404.20	0.39
J	金融业	22,713,615.48	0.82
K	房地产业	2,731,553.37	0.10
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	46,724.92	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,803,430.49	0.10
S	综合	-	-
	合计	152,147,251.39	5.52

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	601318	中国平安	269,000	9,955,690.00	0.36
2	601328	交通银行	1,475,600	9,192,988.00	0.33
3	002450	康得新	418,200	7,995,984.00	0.29
4	002019	亿帆医药	440,900	7,429,165.00	0.27
5	002555	三七互娱	348,300	7,234,191.00	0.26
6	000063	中兴通讯	359,300	6,093,728.00	0.22
7	600498	烽火通信	212,160	5,231,865.60	0.19
8	002554	惠博普	668,100	5,131,008.00	0.19
9	600110	诺德股份	370,500	4,990,635.00	0.18
10	000423	东阿阿胶	73,800	4,841,280.00	0.18

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	141,522,478.20	5.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	465,914,703.00	16.90
5	企业短期融资券	211,074,000.00	7.65
6	中期票据	89,442,000.00	3.24
7	可转债(可交换债)	11,998,000.00	0.44
8	同业存单	1,126,390,000.00	40.85
9	其他	-	-
10	合计	2,046,341,181.20	74.21

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

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	111716070	17上海银行CD070	3,000,000	298,800,000.00	10.84
2	011698042	16徐工SCP003	1,500,000	150,840,000.00	5.47
3	111710152	17兴业银行CD152	1,500,000	149,400,000.00	5.42
4	111793146	17杭州银行CD063	1,000,000	98,860,000.00	3.59
5	111695745	16大连银行CD008	1,000,000	97,670,000.00	3.54

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投资。

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投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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 本基金投资的前十名证券发行主体中,慈文传媒股份有限公司于2016年12月19日发布公告称,因违反《上市公司信息披露管理办法》的相关规定,被浙江证监局处以责令整改的行政监管措施。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	223,305.24
2	应收证券清算款	2,009,901.24
3	应收股利	-
4	应收利息	33,473,482.35
5	应收申购款	695.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,707,384.07

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金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

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	博时保泽保本A	博时保泽保本C
本报告期期初基金份额总额	2,474,744,641.36	344,551,297.83
报告期基金总申购份额	458,315.01	25,396.90
减:报告期基金总赎回份额	58,087,372.34	27,460,118.59
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,417,115,584.03	317,116,575.14

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年1月1至2017年3月31日	886,558,000.00	-	-	886,558,000.00	32.42%
产品特有风险							
本报告期内,本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况,当该基金份额持有人选择大比例赎回时,可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时,存在一定的流动性风险;为应对巨额赎回而进行投资标的变现时,可能存在仓位调整困难,甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理,但当基金出现巨额赎回并被全部确认时,申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险,未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。						

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况,根据基金合同相关约定,该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会,并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估,充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下,当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外,当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时,本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

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2017年3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6218.83亿元人民币,其中公募基金规模逾3708.47亿元人民币,累计分红逾807.86亿元人民币,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2017年1季末:

权益基金方面,标准指数股票型基金里,博时深证基本面200ETF今年以来净值增长率为7.56%,在同类340只基金中排名前1/10,博时裕富沪深300指数今年以来净值增长率排名前1/6;股票型分级子基金里,博时中证银行指数分级B今年以来净值增长率为9.14%,在同类130只基金中排名前3/10;混合偏股型基金中,博时行业轮动基金今年以来净值增长率为14%,在同类400只基金中排名第二;混合灵活配置型基金中,博时产业新动力基金今年以来净值增长率为7.3%,在同类596只中排名前1/10。

保本型基金中,博时保泰保本混合基金今年以来净值增长率在同类176只中排名前1/10;绝对收益目标基金里,博时新起点灵活配置混合今年以来净值增长率在同类基金中排名前1/10。

黄金基金类,博时黄金ETFLOF类今年以来净值增长率5.35%,在同类19只中排名第一。

固收方面,长期标准债券型基金中,博时信用债纯债(A类),博时裕邵纯债债券,博时智臻纯债债券基金今年以来净值增长率在同类180只排名前1/10;普通债券型基金中,博时信用债券基金,博时天颐债券基金今年以来净值增长率在191只中排名前1/10;货币市场基金里,博时外服货币今年以来净值增长率在同类245只中排名前1/4;封闭式标准债券型基金中,博时安心收益定开基金在同类中排名前1/2。

QDII基金,博时大中华亚太精选股票基金(QDII),博时大中华亚太精选股票基金(QDII)(美元),今年以来净值增长率分别为14.24%及13.46%,同类排名第三及第五。博时亚洲票息收益债券(QDII)(美元)今年以来净值增长率在同类33只排名前1/3。

2、其他大事件

2017年3月21日,蚂蚁金服宣布向基金行业开放自运营平台"财富号",支持基金公司在蚂蚁聚宝自运营,精准服务理财用户。博时基金为首批接入试点的金融机构。

2017年3月10日,由中国工商银行私人银行部举办的"第十八届资本市场投资论坛会议"在杭州落下帷幕。工行私行对管理人的过往表现给予充分肯定并对2016年表现突出的管理人进行了表彰,博时基金荣获"2016年度优秀管理人奖"。

2017年2月22日,第二届中国基金业营销创新高峰论坛暨"金果奖"颁奖典礼在京举办,博时基金一举斩获最佳品牌形象建设奖、最具创新精神奖、最佳自媒体建设奖三项大奖。

2017年1月19日,深交所召开了新一代交易系统上线运行总结会,会上介绍了深交所新一代交易系统运行情况,并表彰了在新一代交易系统上线过程中,积极参与各项准备和测试工作,为系统顺利上线做出突出贡献的单位和个人。博时基金被授予新一代交易系统建设先行者、突出贡献单位殊荣。博时基金总技术部牛宏原、陈小平、邓晓东被授予突出贡献奖殊荣。

2017年1月16日,博时基金荣登中央国债登记结算有限责任公司评选的"优秀资产管理机构"榜单,成为全国十家获此殊荣的基金公司之一。

2017年1月12日,由华夏时报、新浪财经联合主办的"第十届金蝉奖颁奖典礼"上,博时基金荣获"2016年度市场营销力公司"奖项。

2017年1月10日,由信息时报主办的"2016年度金狮奖金融行业风云榜"颁奖典礼于广州盛大举办,博时基金斩获"年度最佳投研基金公司"大奖。

2017年1月6日,由东方财富网、天天基金网主办的"2016东方财富风云榜"评选活动于广州举行,博时基金荣膺"2016年度最佳基金公司"大奖,同时,旗下产品博时银智100荣获"2016年度最受欢迎新发基金奖"。

§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保泽保本混合型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时保泽保本混合型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时保泽保本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报告期内博时保泽保本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、基金托管人住所

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
二〇一七年四月二十二日

博时保证金实时交易型货币市场基金

【2017】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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十二日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时保证金货币ETF
场内简称	博时货币
基金主代码	511860
交易代码	511860
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月25日
报告期末基金份额总额	24,901,790.90份
投资目标	在保持相对低风险和相对高流动性的前提下获得高于业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金在资产配置时应充分考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征。在风险与收益的配比中,力求降低各类风险,并争取在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的较低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	22,483,739.71
2.本期利润	22,483,739.71
3.期末基金资产净值	2,490,179,089.20

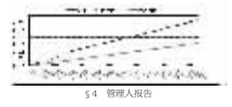
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.6515%	0.0012%	0.3329%	0.0000%	0.3186%	0.0012%

3.2.2自基金合同生效以来 基金累计净值收益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		
魏柳	固定收益部副总监兼博时投资副总监/基金经理	2015-06-09	-	8.7	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20天债券基金、博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月新定期支付债券基金、博时双月新定期支付债券基金的基金经理。现任固定收益总部基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、博时天天增利货币市场基金、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金、博时现金宝货币市场基金、博时现金收益货币基金、博时安盈债券基金、博时保证金货币ETF基金、博时外服货币基金、博时安荣18个月定期开放债券基金、博时裕创纯债债券型证券投资基金、博时安润18个月定开债基金、博时裕盛纯债债券基金、博时产业债纯债基金、博时安仁一年定开债基金、博时合利货币基金、博时安恒18个月定开债基金、博时安泰一年定开债基金、博时聚享纯债债券基金、博时裕鹏纯债债券基金的基金经理。

4.2 管理人对投资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

报告期内,市场整体反弹,主要指数均有一定涨幅。我们在一季度适度增加了仓位,并以价值和合理成长为基本配置,特别侧重于参与了价值股的投资机会。我们认为,一季度过后,市场风险逐渐增加,因此二季度将控制仓位,以精选个股为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年3月31日,本基金A类基金份额净值为1.017元,份额累计净值为1.017元;C类基金份额净值为1.015元,份额累计净值为1.015元。报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为0.99%,C类基金份额净值增长率为1.00%,同期业绩基准增长率0.68%。

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	139,460,247.89	5.09
	其中:股票	139,460,247.89	5.09
2	固定收益投资	2,278,025,591.80	83.14
	其中:债券	2,278,025,591.80	83.14
	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	5,000,000.00	0.18
	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	275,127,850.94	10.04
7	其他各项资产	42,369,135.24	1.55
8	合计	2,739,982,825.87	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	10,604,917.00	0.45
C	制造业	87,585,304.96	3.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	160,331.21	0.01
E	建筑业	1,806,223.50	0.08
F	批发和零售业	307,140.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,466,498.41	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,010,566.20	0.43
J	金融业	21,276,613.01	0.91
K	房地产业	2,508,155.52	0.11
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	46,724.92	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,670,843.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	139,460,247.89	5.96

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	601328	交通银行	1,463,500	9,117,605.00	0.39
2	601318	中国平安	243,900	9,026,739.00	0.39
3	002450	康得新	393,799	7,529,436.88	0.32
4	002019	亿帆医药	395,900	6,670,915.00	0.29
5	002555	三七互娱	320,400	6,654,708.00	0.28
6	000063	中兴通讯	334,400	5,671,424.00	0.24
7	600498	烽火通信	191,100	4,712,526.00	0.20
8	002554	惠博普	602,200	4,624,896.00	0.20
9	600110	诺德股份	331,200	4,461,264.00	0.19
10	000423	东阿阿胶	65,900	4,323,040.00	0.18

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	127,681,224.60	5.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	195,720,000.00	8.37
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	843,140,367.20	36.05
5	企业短期融资券	140,792,000.00	6.02
6	中期票据	108,009,000.00	4.62
7	可转债(可交换债)	11,998,000.00	0.51
8	同业存单	821,795,000.00	35.14
9	其他	28,890,000.00	1.24
10	合计	2,278,025,591.80	97.40

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

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	1628013	16兴业绿色金融债02	2,000,000	195,720,000.00	8.37
2	111699664	16杭州银行CD168	2,000,000	192,300,000.00	8.22
3	111714119	17江苏银行CD119	2,000,000	191,560,000.00	8.19
4	019639	16国债11	1,200,000	119,928,000.00	5.13
5	101654065	16中建材MTN002	1,100,000	108,009,000.00	4.62

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本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现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、处罚的情形。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	149,977,681.38
	其中:政策性金融债	149,977,681.38
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	149,977,681.38

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金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

本基金本报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	博时保证金货币ETF
本报告期期初基金份额总额	75,363,480.92
报告期基金总申购份额	6,673,290.94
报告期基金总赎回份额	57,134,980.96
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	24,901,790.90

§7 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