

## 博时聚享纯债债券型证券投资基金

## [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

报告送达日期:二〇一七年四月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及董事会秘书所载数据是否与定期报告的数据一致,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。

基金托管人的董事、监事及董事会秘书所载数据是否与定期报告的数据一致,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。

基金合同的当事人在报告期内不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金合同的当事人在报告期内不存在损害基金份额持有人利益的行为,但未保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表未来表现。投资者在投资前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报吿书对财务资料未经审计。

本报吿书自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1564099	16国开059	400,000	40,300,000.00	39.98
2	110906001	16国开0601	400,000	39,300,000.00	38.69
3	110912097	16农商银行C20078	400,000	36,322,000.00	38.13
4	170901	17农交01	100,000	9,970,000.00	4.71
5	110801112	16农银068	100,000	9,848,000.00	4.66

5.6 报告期内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 报告期内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 报告期内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 报告期内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 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名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 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名组合类金融产品投资情况

本基金本报告期末未持有组合类金融产品。

5.12 本期报告期内,本基金投资的前十名证券没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一日内受到公开谴责、处罚的情形。

5.13 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。

5.14 其他资产构成情况

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收申购款	-
4	应收赎回款	3,090,314.30
5	应收出借证券款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,090,314.30

5.15 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.15.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.15.2 报告期内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。

5.15.3 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。

5.16 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日至2017年3月31日)

1.本期已实现收益 1,331,792.43

2.期初现金及现金等价物余额 1,110,211.31

3.加权平均基金份额本期利润 0.0063

4.期末基金份额净值 211,477.6036

5.期末可供分配基金份额利润 10000

6.期末可供分配利润 211,477.6036

注:本产品已实现收益指基金本报告期间利息收入、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。

§ 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间 证券从业年限 说明

魏巍 固定收益投资总监兼基金经理 2016-12-19 -

注:2016年12月19日,因公司内部调整,本基金基金经理由魏巍担任。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金基金经理遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则,本基金合同和其相关法律文件的规定,勤勉尽责地履行了诚实守信、谨慎勤勉的职责,没有损害基金份额持有人的利益。

4.3 公司公平交易专项说明

4.4 公平交易制度执行的情况

报告期内,本基金严格执行了《证券投资基金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。

4.5 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。

4.6 报告期内本基金未参与新股发行承销工作。

4.7 报告期内本基金未持有股票。

4.8 报告期内本基金未持有债券品种分类的债券投资组合

4.9 报告期内本基金未持有权证品种分类的债券投资组合

4.10 报告期内本基金未持有贵金属品种分类的债券投资组合

4.11 报告期内本基金未持有股指期货品种分类的债券投资组合

4.12 报告期内本基金未持有国债期货品种分类的债券投资组合

4.13 报告期内本基金未持有股票期权品种分类的债券投资组合

4.14 报告期内本基金未持有商品期货品种分类的债券投资组合

4.15 报告期内本基金未持有商品期权品种分类的债券投资组合

4.16 报告期内本基金未持有信用衍生品品种分类的债券投资组合

4.17 报告期内本基金未持有权证投资组合

4.18 报告期内本基金未持有股指期货投资组合

4.19 报告期内本基金未持有国债期货投资组合

4.20 报告期内本基金未持有商品期货投资组合

4.21 报告期内本基金未持有商品期权投资组合

4.22 报告期内本基金未持有信用衍生品期权投资组合

4.23 报告期内本基金未持有权证期权投资组合

4.24 报告期内本基金未持有商品期货期权投资组合

4.25 报告期内本基金未持有商品期权期权投资组合

4.26 报告期内本基金未持有信用衍生品期权期权投资组合

4.27 报告期内本基金未持有权证期权期权投资组合

4.28 报告期内本基金未持有商品期货期权期权投资组合

4.29 报告期内本基金未持有商品期权期权投资组合

4.30 报告期内本基金未持有信用衍生品期权期权投资组合

4.31 报告期内本基金未持有权证期权期权投资组合

4.32 报告期内本基金未持有商品期货期权期权投资组合

4.33 报告期内本基金未持有商品期权期权投资组合

4.34 报告期内本基金未持有信用衍生品期权期权投资组合

4.35 报告期内本基金未持有权证期权期权投资组合

4.36 报告期内本基金未持有商品期货期权期权投资组合

4.37 报告期内本基金未持有商品期权期权投资组合

4.38 报告期内本基金未持有信用衍生品期权期权投资组合

4.39 报告期内本基金未持有权证期权期权投资组合

4.40 报告期内本基金未持有商品期货期权期权投资组合

4.41 报告期内本基金未持有商品期权期权投资组合

4.42 报告期内本基金未持有信用衍生品期权期权投资组合

4.43 报告期内本基金未持有权证期权期权投资组合

4.44 报告期内本基金未持有商品期货期权期权投资组合

4.45 报告期内本基金未持有商品期权期权投资组合

4.46 报告期内本基金未持有信用衍生品期权期权投资组合

4.47 报告期内本基金未持有权证期权期权投资组合

4.48 报告期内本基金未持有商品期货期权期权投资组合

4.49 报告期内本基金未持有商品期权期权投资组合

4.50 报告期内本基金未持有信用衍生品期权期权投资组合

4.51 报告期内本基金未持有权证期权期权投资组合

4.52 报告期内本基金未持有商品期货期权期权投资组合

4.53 报告期内本基金未持有商品期权期权投资组合

4.54 报告期内本基金未持有信用衍生品期权期权投资组合

4.55 报告期内本基金未持有权证期权期权投资组合

4.56 报告期内本基金未持有商品期货期权期权投资组合

4.57 报告期内本基金未持有商品期权期权投资组合

4.58 报告期内本基金未持有信用衍生品期权期权投资组合

4.59 报告期内本基金未持有权证期权期权投资组合

4.60 报告期内本基金未持有商品期货期权期权投资组合

4.61 报告期内本基金未持有商品期权期权投资组合

4.62 报告期内本基金未持有信用衍生品期权期权投资组合

4.63 报告期内本基金未持有权证期权期权投资组合

4.64 报告期内本基金未持有商品期货期权期权投资组合

4.65 报告期内本基金未持有商品期权期权投资组合

4.66 报告期内本基金未持有信用衍生品期权期权投资组合

4.67 报告期内本基金未持有权证期权期权投资组合

4.68 报告期内本基金未持有商品期货期权期权投资组合

4.69 报告期内本基金未持有商品期权期权投资组合

4.70 报告期内本基金未持有信用衍生品期权期权投资组合

4.71 报告期内本基金未持有权证期权期权投资组合

4.72 报告期内本基金未持有商品期货期权期权投资组合

4.73 报告期内本基金未持有商品期权期权投资组合

4.74 报告期内本基金未持有信用衍生品期权期权投资组合

4.75 报告期内本基金未持有权证期权期权投资组合

4.76 报告期内本基金未持有商品期货期权期权投资组合

4.77 报告期内本基金未持有商品期权期权投资组合

4.78 报告期内本基金未持有信用衍生品期权期权投资组合

4.79 报告期内本基金未持有权证期权期权投资组合

4.80 报告期内本基金未持有商品期货期权期权投资组合

4.81 报告期内本基金未持有商品期权期权投资组合

4.82 报告期内本基金未持有信用衍生品期权期权投资组合

4.83 报告期内本基金未持有权证期权期权投资组合

4.84 报告期内本基金未持有商品期货期权期权投资组合

4.85 报告期内本基金未持有商品期权期权投资组合

4.86 报告期内本基金未持有信用衍生品期权期权投资组合

4.87 报告期内本基金未持有权证期权期权投资组合