

博时富嘉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
报告送出日期:二〇一七年四月二十一日
§ 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。
基金托管人根据法律法规的规定复核了本报告中的财务数据、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。
本报告期财务资料未经审计。

报告期[2017年1月1日至3月31日止]

§ 2 基金产品概况

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	49,800,000.00	9.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	295,794,000.00	50.14
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业债	67,116,500.00	11.42
6	中期票据	69,367,000.00	13.09
7	公司债(可交换)	-	-
8	资产支持券	100,347,000.00	21.08
9	其他	-	-
10	合计	617,415,000.00	102.44

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	49,800,000.00	9.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	295,794,000.00	50.14
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业债	67,116,500.00	11.42
6	中期票据	69,367,000.00	13.09
7	公司债(可交换)	-	-
8	资产支持券	100,347,000.00	21.08
9	其他	-	-
10	合计	617,415,000.00	102.44

§ 3 基金利润按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

报告期[2017年1月1日至3月31日止]

§ 4 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	1070401	17763801	560,000	40,450,000.00	9.07
2	1060314	1606114	560,000	40,400,000.00	9.06
3	1060022	1606120	560,000	40,400,000.00	9.06
4	1020403	17763701	560,000	40,230,000.00	9.04
5	1060208	1606105	560,000	40,930,000.00	9.78

§ 5 报告期利润按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资的前五名债券投资明细

报告期[2017年1月1日至3月31日止]

§ 6 基金管理费

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	1070401	17763801	560,000	40,450,000.00	9.07
2	1060314	1606114	560,000	40,400,000.00	9.06
3	1060022	1606120	560,000	40,400,000.00	9.06
4	1020403	17763701	560,000	40,230,000.00	9.04
5	1060208	1606105	560,000	40,930,000.00	9.78

§ 7 基金管理费

报告期[2017年1月1日至3月31日止]

§ 8 基金托管费

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	1070401	17763801	560,000	40,450,000.00	9.07
2	1060314	1606114	560,000	40,400,000.00	9.06
3	1060022	1606120	560,000	40,400,000.00	9.06
4	1020403	17763701	560,000	40,230,000.00	9.04
5	1060208	1606105	560,000	40,930,000.00	9.78

§ 9 基金管理费

报告期[2017年1月1日至3月31日止]

§ 10 基金托管费

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	1070401	17763801	560,000	40,450,000.00	9.07
2	1060314	1606114	560,000	40,400,000.00	9.06
3	1060022	1606120	560,000	40,400,000.00	9.06
4	1020403	17763701	560,000	40,230,000.00	9.04
5	1060208	1606105	560,000	40,930,000.00	9.78

§ 11 基金管理费

报告期[2017年1月1日至3月31日止]

§ 12 基金托管费

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	1070401	17763801	560,000	40,450,000.00	9.07
2	1060314	1606114	560,000	40,400,000.00	9.06
3	1060022	1606120	560,000	40,400,000.00	9.06
4	1020403	17763701	560,000	40,230,000.00	9.04
5	1060208	1606105	560,000	40,930,000.00	9.78

§ 13 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.本期利润	收入/损失	1,584,006.63	
2.期初现金及现金等价物余额	-	122,167.10	
3.期末现金及现金等价物余额	-	10,004.00	
4.期末未实现货币化收益	-	500,158,971.15	
5.期末未实现货币化收益占净值的比例	-	0.961	
6.期末持有的各类债券投资	-	610,120,172.26	
7.期末持有的股票投资	-	0.00	
8.期末持有的其他投资	-	0.00	
9.期末持有的衍生工具	-	0.00	
10.期末持有的买入返售金融资产	-	0.00	
11.期末持有的卖出回购金融资产	-	0.00	
12.期末持有的应收款项	-	0.00	
13.期末持有的其他资产	-	0.00	
14.期末持有的待摊费用	-	0.00	
15.期末持有的其他负债	-	0.00	
16.本期净利得	-	1,584,006.63	
17.本期利息收入	-	0.00	
18.本期减去支取的现金及现金等价物后的现金净额	-	112,167.10	
19.期末现金及现金等价物余额	-	10,004.00	
20.期末持有的待摊费用	-	0.00	
21.期末持有的其他负债	-	0.00	
22.本期净亏损	-	-1,584,006.63	
23.本期利息支出	-	0.00	
24.本期减去支取的现金及现金等价物后的现金净额	-	-112,167.10	
25.期末现金及现金等价物余额	-	-10,004.00	
26.期末持有的待摊费用	-	0.00	
27.期末持有的其他负债	-	0.00	
28.本期净亏损	-	-1,584,006.63	
29.本期利息收入	-	0.00	
30.本期减去支取的现金及现金等价物后的现金净额	-	-112,167.10	
31.期末现金及现金等价物余额	-	-10,004.00	

§ 14 报告期内基金的利润分配情况

报告期[2017年1月1日至3月31日止]