

博时裕发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:广发银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十二日

基金管理人的董事会及基金经理保证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。

基金托管人对本报告的内容予以确认。但本报告依然在本基金合同中规定的时间内披露。

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财产，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。投资人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	博时裕发纯债债券型证券投资基金
基金主代码	002668
交易代码	002668
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年4月6日
报告期末份额净值	0.9970(2017.03.31)
报告期末份额总额	1,007,246,833.05
基金份额净值	—
基金资产净值	—
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期实现收益	5,948,471.63
2.期初利润	2,510,500.26
3.本期平均基金份额利润	0.0042
4.期末基金份额净值	1,007,246,833.05
5.期末基金份额净值	—

注:本基金管理人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据。

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	净值增长率为%	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④	
过去三个月	0.20%	0.08%	-0.2%	0.07%	0.47%	0.01%

3.2.2 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2016年4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第6个月内的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 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
鲁邦旺	固定收益投资部基金经理助理兼固定收益总监/基金经理	2016-04-06	—	2003年之后先后就职于国泰基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理;2008年1月加入广发基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理;2012年1月加入本公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理;2014年1月加入本公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理;2016年4月加入本公司,担任固定收益投资部基金经理助理兼固定收益总监,同时担任本公司基金经理。2016年10月起担任本公司基金经理。
陈勇强	固定收益投资部基金经理助理兼固定收益总监/基金经理	—	1115	2006年1月加入广发基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理;2011年1月加入本公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理;2013年1月加入本公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理;2014年1月加入本公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理;2016年4月加入本公司,担任固定收益投资部基金经理助理兼固定收益总监,同时担任本公司基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本基金报告期内,基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于客户的原则,依照有关法律法规的规定和本基金合同的约定,诚实守信、勤勉尽责地管理本基金,并以维护基金份额持有人的利益为最高准则,并履行了相应的义务。

4.3 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《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关规则。

4.4 报告期内基金投资策略和操作分析

报告期内本基金投资策略和操作分析。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.012元,累计份额净值为1.012元,报告期内净值增长率为0.20%,同期业绩比较基准净值为-0.27%。

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

单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权证投资	—	—
2	固定收益投资	864,027,500.00	86.29%
3	货币市场基金	864,027,500.00	86.29%
4	资产支持证券	—	—
5	贵金属投资	—	—
6	买入返售金融资产	117,000,296.40	11.07%
7	其中:买断式回购资产	—	—
8	银行存款和结算备付金	10,816,400.27	1.07%
9	其他资产	16,204,915.16	1.51%
10	合计	1,007,640,110.63	100.00%

5.2 报告期内按行业分类的投资组合

本基金未按行业分类披露。

5.3 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金报告期末未持有股票。

5.4 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金报告期末未持有债券。

5.5 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名固定收益类投资明细

本基金报告期末未持有固定收益类投资。

5.6 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属投资。

5.7 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名权证及衍生品投资明细

本基金报告期末未持有权证及衍生品。

5.8 报告期内公布的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

本基金报告期末未持有资产支持证券投资。

5.9 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名保险及养老金产品投资明细

本基金报告期末未持有保险及养老金产品投资。

5.10 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名期货及衍生品投资明细

本基金报告期末未持有期货及衍生品投资。

5.11 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金报告期末未持有股票。

5.12 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名商品基金投资明细

本基金报告期末未持有商品基金投资。

5.13 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名黄金及其他贵金属投资明细

本基金报告期末未持有黄金及其他贵金属投资。

5.14 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名农村合作金融机构投资明细

本基金报告期末未持有农村合作金融机构投资。

5.15 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名保险类公司投资明细

本基金报告期末未持有保险类公司投资。

5.16 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名证券公司投资明细

本基金报告期末未持有证券公司投资。

5.17 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名期货公司投资明细

本基金报告期末未持有期货公司投资。

5.18 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名基金公司投资明细

本基金报告期末未持有基金公司投资。

5.19 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名保险公司投资明细

本基金报告期末未持有保险公司投资。

5.20 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名银行投资明细

本基金报告期末未持有银行投资。

5.21 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名信托公司投资明细

本基金报告期末未持有信托公司投资。

5.22 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名证券投资基金投资明细

本基金报告期末未持有证券投资基金投资。

5.23 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名保险资产管理公司投资明细

本基金报告期末未持有保险资产管理公司投资。

5.24 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名企业年金基金投资明细

本基金报告期末未持有企业年金基金投资。

5.25 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名养老基金投资明细

本基金报告期末未持有养老基金投资。

5.26 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名其他基金投资明细

本基金报告期末未持有其他基金投资。

5.27 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名保险私募基金投资明细

本基金报告期末未持有保险私募基金投资。

5.28 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名证券交易所交易型开放式基金投资明细

本基金报告期末未持有证券交易所交易型开放式基金投资。

5.29 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货及金融衍生品类投资明细

本基金报告期末未持有商品期货及金融衍生品类投资。

5.30 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属及珠宝首饰投资明细

本基金报告期末未持有贵金属及珠宝首饰投资。

5.31 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名其他投资明细

本基金报告期末未持有其他投资。

5.32 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金报告期末未持有股票。

5.33 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金报告期末未持有债券。

5.34 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名固定收益类投资明细

本基金报告期末未持有固定收益类投资。

5.35 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属投资。

5.36 报告期内公布的基金资产净值比例大小排序的前十名权证及衍生品投资明细

本基金报告期末未持有权证及衍生品投资。