

2017年12月31日
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:二〇一八年一月二十日

§ 1重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理等人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年1月10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当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2017年1月1日起至2月21日止。

§ 2基金产品概况

41基金基本情况

基金名称 博时富海纯债债券型证券投资基金

基金简称 博时富海纯债

基金代码 004323

交易代码 004323

基金运作方式 封闭式

基金合同生效日 2017年3月6日

报告期末基金资产净值 200,729,777.00

投资目标 在控制风险和保持资产流动性的前提下,力争长期实现超越业绩比较基准的回报。

本基金通过投资于不同久期的债券类资产,通过定期调整资产配置比例,实现基金资产在不同久期的债券类资产间的配置,从而实现基金资产的保值增值。

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当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2017年1月1日起至2月21日止。

§ 3主要财务指标

31主要财务指标

报告期(2017年1月1日-2017年12月31日)

单位:人民币元

主要财务指标

报告期初基金资产净值 -775,635.69

本期利润 -2,373,916.80

净值收益率 -0.01%

期末基金资产净值 201,406,264.83

32基金净值表现

32.1报告期内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

报告期初基金份额净值 -1.07%

净值增长率 -65%

净值增长率 -0.35%

报告期末基金份额净值 -0.02%

32.2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

注:本基金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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益可能低于上述数字。

32.3基金净值表现

32.3.1报告期内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

报告期初基金份额净值 -1.07%

净值增长率 -65%

净值增长率 -0.35%

报告期末基金份额净值 -0.02%

32.3.2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

注:本基金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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益可能低于上述数字。

32.4基金净值表现

32.4.1报告期内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

报告期初基金份额净值 -1.07%

净值增长率 -65%

净值增长率 -0.35%

报告期末基金份额净值 -0.02%

32.4.2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

注:本基金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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益可能低于上述数字。

32.5基金净值表现

32.5.1报告期内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

报告期初基金份额净值 -1.07%

净值增长率 -65%

净值增长率 -0.35%

报告期末基金份额净值 -0.02%

32.5.2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

注:本基金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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益可能低于上述数字。

32.6基金净值表现

32.6.1报告期内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

报告期初基金份额净值 -1.07%

净值增长率 -65%

净值增长率 -0.35%

报告期末基金份额净值 -0.02%

32.6.2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

注:本基金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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益可能低于上述数字。

32.7基金净值表现

32.7.1报告期内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

报告期初基金份额净值 -1.07%

净值增长率 -65%

净值增长率 -0.35%

报告期末基金份额净值 -0.02%

32.7.2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

注:本基金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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益可能低于上述数字。

32.8基金净值表现

32.8.1报告期内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

报告期初基金份额净值 -1.07%

净值增长率 -65%

净值增长率 -0.35%

报告期末基金份额净值 -0.02%

32.8.2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

注:本基金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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益可能低于上述数字。

32.9基金净值表现

32.9.1报告期内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

报告期初基金份额净值 -1.07%

净值增长率 -65%

净值增长率 -0.35%

报告期末基金份额净值 -0.02%

32.9.2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

注:本基金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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益可能低于上述数字。

32.10基金净值表现

32.10.1报告期内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

报告期初基金份额净值 -1.07%

净值增长率 -65%

净值增长率 -0.35%

报告期末基金份额净值 -0.02%

32.10.2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

注:本基金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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益可能低于上述数字。

32.11基金净值表现

32.11.1报告期内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

报告期初基金份额净值 -1.07%

净值增长率 -65%

净值增长率 -0.35%

报告期末基金份额净值 -0.02%

32.11.2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

注:本基金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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益可能低于上述数字。

32.12基金净值表现

32.12.1报告期内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

报告期初基金份额净值 -1.07%

净值增长率 -65%

净值增长率 -0.35%

报告期末基金份额净值 -0.02%

32.12.2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

注:本基金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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益可能低于上述数字。

32.13基金净值表现

32.13.1报告期内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

报告期初基金份额净值 -1.07%

净值增长率 -65%

净值增长率 -0.35%

报告期末基金份额净值 -0.02%

32.13.2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

注:本基金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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益可能低于上述数字。

32.14基金净值表现

32.14.1报告期内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

报告期初基金份额净值 -1.07%

净值增长率 -65%

净值增长率 -0.35%

报告期末基金份额净值 -0.02%

32.14.2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

注:本基金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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益可能低于上述数字。

32.15基金净值表现

32.15.1报告期内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

报告期初基金份额净值 -1.07%

净值增长率 -65%

净值增长率 -0.35%