

博时弘盈定期开放混合型证券投资基金
2017 年第 1 季度报告
2017 年 3 月 31 日

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。

基金托管人招商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	博时弘盈定开混合	
基金主代码	160520	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 8 月 1 日	
报告期末基金份额总额	3,329,657,442.45 份	
投资目标	在谨慎投资的前提下，本基金力争超越业绩比较基准，追求基金资产的保值和增值。	
投资策略	封闭期内，主要采用事件驱动的投资策略；开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*25%+中债综合财富（总值）指数收益率*75%	
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金品种。	
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	
下属分级基金的基金简称	博时弘盈定开混合 A	博时弘盈定开混合 C
下属分级基金的场内简称	弘盈 A	-
下属分级基金的交易代码	160520	160521
报告期末下属分级基金的份额总额	2,048,539,436.19 份	1,281,118,006.26 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)	
	博时弘盈定开混合 A	博时弘盈定开混合 C
1.本期已实现收益	3,993,721.20	-28,492.47
2.本期利润	13,807,751.89	6,082,670.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.0067	0.0047
4.期末基金资产净值	2,054,794,827.89	1,278,243,757.80
5.期末基金份额净值	1.0031	0.9978

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。

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. 博时弘盈定开混合A:

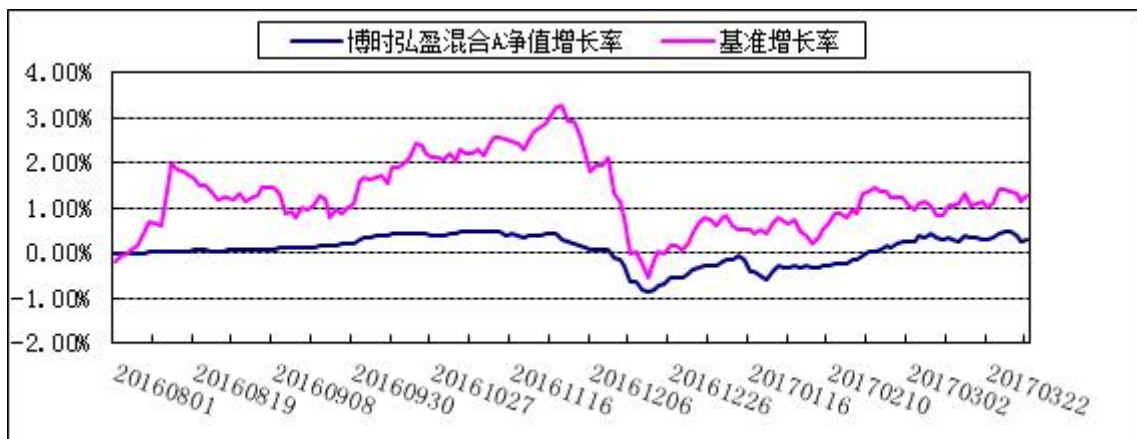
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去三 个月	0.68%	0.07%	0.84%	0.15%	-0.16%	-0.08%

2. 博时弘盈定开混合C:

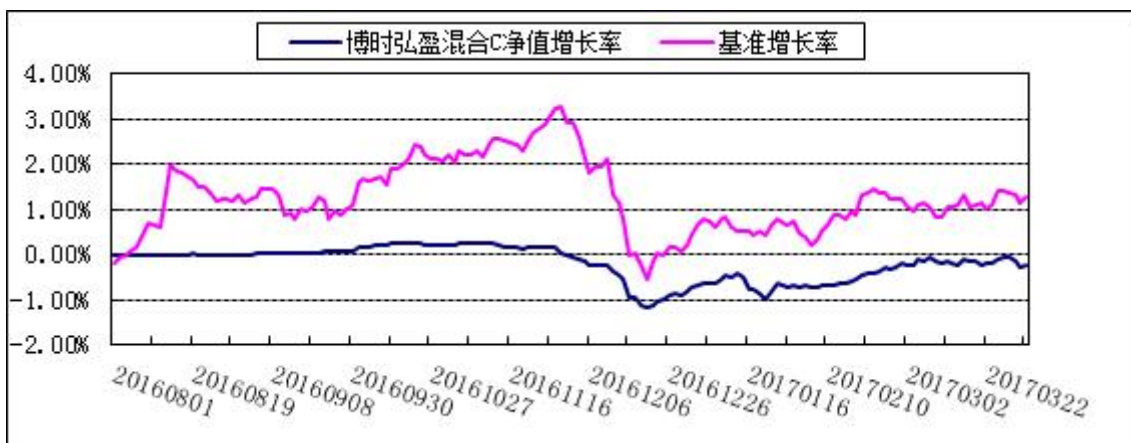
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去三 个月	0.48%	0.07%	0.84%	0.15%	-0.36%	-0.08%

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. 博时弘盈定开混合A:



2. 博时弘盈定开混合C:



注：本基金合同于 2016 年 8 月 1 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金合同第十三部分“（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		
陈鹏扬	基金经理	2016-08-01	-	8.8	2008 年至 2012 年在中金公司工作。2012 年加入博时基金管理有限公司，历任研究员、资深研究员、投资经理。现任博时裕隆混合基金兼博时睿远定增混合基金、博时睿利定增混合基金、博时弘盈定期开放混合基金、博时睿益定增混合基金、博时弘裕 18 个月定开债基金、博时弘泰定期开放混合基金、博时睿丰定开混合基金、博时弘康 18 个月定开债基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、本基金基金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

1 季度基金净值上涨，但略弱于基准，主要由于二级市场呈现上涨，而基金产品投资的定增项目净值须采取摊余法计价收益确认需要一定时间影响所致。

展望 2 季度，在国内房价继续上涨以及美元加息背景下我们认为货币政策边际上将会继续收紧，国内经济复苏走势仍将延续，但力度会有所放缓，房地产、汽车销售等经济先行指标来看均面临一定压力，我们会继续维持较为稳健的债券投资策略。

股票部分来看，基金产品已经完成定增项目建仓，还有少量权益类仓位在择机参与二级市场定增套利相关机会。整体权益市场而言，部分权益类资产相对于债券而言吸引力依旧较大，且房地产严格调控之下社会增量财富配置将有望向股票市场倾斜，从大类资产角度而言股票市场整体呈现机遇大于风险。但同时我们也应该看到市场分化情况依旧存在，高估与低估并存，我们会坚持从自下而上角度去挑选中其成长性较好的股票，主要集中在科技、消费等领域细分市场中竞争力趋于提升的公司之中。

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 1.0031 元，份额累计净值为 1.0031 元；C 类基金份额净值为 0.9978 元，份额累计净值为 0.9978 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.68%，C 类基金份额净值增长率为 0.48%，同期业绩基准增长率 0.84%。

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	653,348,571.06	18.86
	其中：股票	653,348,571.06	18.86
2	固定收益投资	2,712,516,666.00	78.29

	其中：债券	2,612,516,666.00	75.40
	资产支持证券	100,000,000.00	2.89
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	49,800,192.00	1.44
	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	7,797,447.98	0.23
7	其他各项资产	41,457,122.84	1.20
8	合计	3,464,919,999.88	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	33,650,888.92	1.01
C	制造业	342,087,937.65	10.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	103,287,381.96	3.10
E	建筑业	46,309,798.64	1.39
F	批发和零售业	42,542,911.26	1.28
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	65,182,098.24	1.96
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,198,449.04	0.28
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,089,105.35	0.33
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	653,348,571.06	19.60

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	600864	哈投股份	10,604,454	103,287,381.96	3.10
2	601877	正泰电器	5,688,282	101,478,950.88	3.04
3	600258	首旅酒店	3,121,748	65,182,098.24	1.96
4	002568	百润股份	2,280,000	48,199,200.00	1.45
5	600072	中船科技	2,938,439	46,309,798.64	1.39
6	601969	海南矿业	3,254,438	33,650,888.92	1.01
7	002528	英飞拓	4,867,257	32,707,967.04	0.98
8	000519	中兵红箭	2,475,861	32,062,399.95	0.96

9	002503	搜于特	2,380,952	30,690,471.28	0.92
10	002541	鸿路钢构	1,532,312	26,064,627.12	0.78

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	552,226,666.00	16.57
5	企业短期融资券	1,407,271,000.00	42.22
6	中期票据	138,904,000.00	4.17
7	可转债（可交换债）	12,077,000.00	0.36
8	同业存单	240,890,000.00	7.23
9	其他	261,148,000.00	7.84
10	合计	2,612,516,666.00	78.38

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	011698426	16 康美 SCP001	3,000,000	300,120,000.00	9.00
2	136711	16 国君 G5	1,300,000	126,035,000.00	3.78
3	011698356	16 大北农科 SCP001	1,000,000	100,120,000.00	3.00
4	011759022	17 物产中大 SCP004	1,000,000	100,010,000.00	3.00
5	041659039	16 九州通 CP001	1,000,000	99,680,000.00	2.99

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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比（%）
1	142768	花呗 19A1	1,000,000.00	100,000,000.00	3.00

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

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中除 16 国君 G5、16 国君 G3 的发行主体国泰君安（601211）外，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。

国泰君安证券股份有限公司于 2016 年 12 月 27 日发布公告称，因违反了《非上市公司公众公司监督管理办法》第六条规定和《证券公司内部控制指引》的相关规定，被中国证监会责令改正、增加内部合规检查次数并提交合规检查报告的行政监管措施。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

5.11.2 报告期内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	33,240.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	41,423,882.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,457,122.84

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601877	正泰电器	101,478,950.88	3.04	非公开发行认购
2	600864	哈投股份	103,287,381.96	3.10	非公开发行认购
3	600258	首旅酒店	65,182,098.24	1.96	非公开发行认购
4	002568	百润股份	48,199,200.00	1.45	非公开发行认购
5	600072	中船科技	46,309,798.64	1.39	非公开发行认购
6	601969	海南矿业	33,650,888.92	1.01	非公开发行认购
7	002528	英飞拓	32,707,967.04	0.98	非公开发行认购
8	000519	中兵红箭	32,062,399.95	0.96	非公开发行认购
9	002503	搜于特	30,690,471.28	0.92	非公开发行认购
10	002541	鸿路钢构	26,064,627.12	0.78	非公开发行认购

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	博时弘盈定开混合 A	博时弘盈定开混合 C
本报告期期初基金份额总额	2,048,539,436.19	1,281,118,006.26
报告期基金总申购份额	-	-
减：报告期基金总赎回份额	-	-
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,048,539,436.19	1,281,118,006.26

§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份额。

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

无。

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 1/5；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 ETF(D 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)、博时裕昂纯债债券、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。博时基金信息技术部车宏原、陈小平、祁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弘盈定期开放混合型证券投资基金设立的文件
- 9.1.2 《博时弘盈定期开放混合型证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时弘盈定期开放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 博时弘盈定期开放混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 9.1.6 报告期内博时弘盈定期开放混合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、基金托管人处

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