

博时策略灵活配置混合型证券投资基金

[2015] 第三季度报告

基金管理人:博时基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

§ 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、完整性负个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月23日复核了本报告中的财务数据、净值表现和投资组合报告等內容，保证复核结果不存在虚假记载、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2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	博时策略混合
基金主代码	660012
交易代码	660012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年9月11日
报告期末基金份额总额	436,565,164.28份
投资目标	通过运用多种投资策略，在股票和债券之间灵活配置资产，并对成长、价值风格资产进行分析并择时配置，以追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将通过上证综指和创业板指数的相对表现，结合对宏观经济、行业景气度、政策环境、市场情绪等的综合分析，选择具有较好配置价值的行业，从而进行前瞻性的决策。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中国国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，混合型基金的风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益品种。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	21,863,369.18
2.本期利润	-113,143,042.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.02620
4.期末基金份额净值	494,066,960.65
5.期末基金份额净值	1.132

注:本期已实现收益指基金利息收入、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。

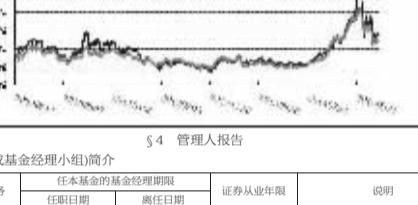
前述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

阶段	净值增长率为 净值增长率为 净值增长率为 净值增长率为 过去三个月	①-②	②-④
过去三个月	-17.07% 3.26% -16.73% 2.01% -0.04% 1.29%		

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(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
孙少峰	基金经理	2015-09-23	-	8
王军	基金经理 (拟任基金经理)	2011-02-28	-	11

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，为持有人谋求最大利益。报告期内本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 公平交易专户说明

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 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告表明基金管理人未发生利用固有资金买卖本基金的情况。

不过，在本基金最后一个月，部分期限跌幅较大的个股出现了反弹，虽然指数反弹不强，但市场整体悲观的情绪在逐步有所缓解。

5.1.1 告知报告期基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.1.2 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。

5.1.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	276,334.11
2	应收证券清算款	2,465,631.71
3	应收股利	
4	应收利息	4,502,268.99
5	应收申购款	67,585.00
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	7,311,720.48

5.1.4 告知报告期持有的前十名证券的名称及持有数量

5.1.5 告知报告期持有的前十名股票的名称及占基金资产净值的比例

5.1.6 告知报告期持有的前十名债券的名称及占基金资产净值的比例

5.1.7 告知报告期持有的前十名贵金属的名称及占基金资产净值的比例

5.1.8 告知报告期持有的其他投资的名称及占基金资产净值的比例

5.1.9 告知报告期持有的权证的名称及占基金资产净值的比例

5.1.10 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.11 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.12 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.13 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.14 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.15 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.16 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.17 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.18 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.19 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.20 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.21 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.22 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.23 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.24 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.25 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.26 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.27 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.28 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.29 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.30 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.31 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.32 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.33 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.34 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.35 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.36 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.37 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.38 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.39 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.40 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.41 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.42 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.43 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.44 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.45 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.46 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.47 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.48 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.49 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.50 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.51 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.52 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.53 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.54 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.55 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.56 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.57 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.58 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.59 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.60 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.61 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.62 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.63 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.64 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.65 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.66 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.67 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.68 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.69 告知报告期持有的其他负债的名称及占基金资产净值的比例

5.1.70 告知报告期持有的其他资产的名称及占基金资产净值的比例

5.1.71 告知报告期