

博时逆向投资混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
无。

5.5 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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	202,063,286.73	63.04
2	其中:股票	202,063,286.73	63.04
3	固定收益投资	12,387,064.00	3.87
4	其中:债券	12,387,064.00	3.87
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	82,660,000.00	26.08
7	其中:买断式回购	-	-
8	资产支持证券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	312,110,350.73	96.01

5.2 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

代码	证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	兴业、浦发	13,966,772.00	4.38
B	平安	-	-
C	浦发	149,438,080.71	44.17
D	电力、热力、燃气及生活	-	-
E	煤炭	-	-
F	煤炭	-	-
G	煤炭	-	-
H	煤炭	-	-
I	煤炭	-	-
J	煤炭	-	-
K	煤炭	-	-
L	煤炭	-	-
M	煤炭	-	-
N	煤炭	-	-
O	煤炭	-	-
P	煤炭	-	-
Q	煤炭	-	-
R	煤炭	-	-
S	煤炭	-	-
T	煤炭	-	-
合计	合计	202,063,286.73	63.04

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	100025	国债	430,288	17,395,283.08	5.43
2	000077	国债	495,227	16,396,794.41	5.25
3	100020	国债	694,926	16,484,133.66	5.12
4	300086	国债	601,041	15,966,772.00	4.94
5	100080	国债	1,697,898	13,490,996.39	4.19
6	000227	国债	1,638,280	11,980,344.00	3.70
7	100089	国债	242,100	11,260,200.00	3.49
8	100077	国债	513,468	10,360,100.00	3.32
9	100077	国债	438,088	9,968,262.00	3.12
10	100088	国债	216,000	9,181,500.00	2.89

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	品种名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	430,288	17,395,283.08	5.43
2	央行票据	495,227	16,396,794.41	5.25
3	金融债券	10,944,000.00	4.30	
4	其中:政策性金融债	10,944,000.00	4.30	
5	企业债券	-	-	
6	资产支持证券	-	-	
7	其他	-	-	
8	合计	108,288,176.74	34.17	

5.5 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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	23,088,680.00	10.67
2	其中:股票	23,088,680.00	10.67
3	固定收益投资	188,339,176.74	87.65
4	其中:债券	188,339,176.74	87.65
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买断式回购	-	-
8	资产支持证券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	211,427,856.74	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,275,676.00	1.12
D	电力、热力、燃气及生活	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,275,736.00	1.12
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	其他	-	-
T	合计	4,551,412.00	2.24

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	000025	招商证券	430,288	17,395,283.08	8.23
2	000077	广发证券	495,227	16,396,794.41	7.76
3	000020	振华重工	694,926	16,484,133.66	7.80
4	300086	达华智能	601,041	15,966,772.00	7.56
5	100080	浦发银行	1,697,898	13,490,996.39	6.38
6	000227	华信软件	1,638,280	11,980,344.00	5.66
7	100089	浦发银行	242,100	11,260,200.00	5.30
8	100077	广发证券	513,468	10,360,100.00	4.92
9	100077	广发证券	438,088	9,968,262.00	4.72
10	100088	浦发银行	216,000	9,181,500.00	4.34

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	品种名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	430,288	17,395,283.08	8.23
2	央行票据	495,227	16,396,794.41	7.76
3	金融债券	10,944,000.00	4.92	
4	其中:政策性金融债	10,944,000.00	4.92	
5	企业债券	-	-	
6	资产支持证券	-	-	
7	其他	-	-	
8	合计	216,467,283.49	100.00	

5.5 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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	23,088,680.00	10.67
2	其中:股票	23,088,680.00	10.67
3	固定收益投资	188,339,176.74	87.65
4	其中:债券	188,339,176.74	87.65
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买断式回购	-	-
8	资产支持证券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	211,427,856.74	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,275,676.00	1.12
D	电力、热力、燃气及生活	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,275,736.00	1.12
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	其他	-	-
T	合计	4,551,412.00	2.24

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	000025	招商证券	430,288	17,395,283.08	8.23
2	000077	广发证券	495,227	16,396,794.41	7.76
3	000020	振华重工	694,926	16,484,133.66	7.80
4	300086	达华智能	601,041	15,966,772.00	7.56
5	100080	浦发银行	1,697,898	13,490,996.39	6.38
6	000227	华信软件	1,638,280	11,980,344.00	5.66
7	100089	浦发银行	242,100	11,260,200.00	5.30
8	100077	广发证券	513,468	10,360,100.00	4.92
9	100077	广发证券	438,088	9,968,262.00	4.72
10	100088	浦发银行	216,000	9,181,500.00	4.34

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	品种名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	430,288	17,395,283.08	8.23
2	央行票据	495,227	16,396,794.41	7.76
3	金融债券	10,944,000.00	4.92	
4	其中:政策性金融债	10,944,000.00	4.92	
5	企业债券	-	-	
6	资产支持证券	-	-	
7	其他	-	-	
8	合计	216,467,283.49	100.00	

5.5 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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	23,088,680.00	10.67
2	其中:股票	23,088,680.00	10.67
3	固定收益投资	188,339,176.74	87.65
4	其中:债券	188,339,176.74	87.65
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买断式回购	-	-
8	资产支持证券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	211,427,856.74	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,275,676.00	1.12
D	电力、热力、燃气及生活	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,275,736.00	1.12
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	其他	-	-
T	合计	4,551,412.00	2.24

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	000025	招商证券	430,288	17,395,283.08	8.23
2	000077	广发证券	495,227	16,396,794.41	7.76
3	000020	振华重工	694,926	16,484,133.66	7.80
4	300086	达华智能	601,041	15,966,772.00	7.56
5	100080	浦发银行	1,697,898	13,490,996.39	6.38
6	000227	华信软件	1,638,280	11,980,344.00	5.66
7	100089	浦发银行	242,100	11,260,200.00	5.30
8	100077	广发证券	513,468	10,360,100.00	4.92
9	100077	广发证券	438,088	9,968,262.00	4.72
10	100088	浦发银行	216,000	9,181,500.00	4.34

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	品种名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	430,288	17,395,283.08	8.23
2	央行票据	495,227	16,396,794.41	7.76
3	金融债券	10,944,000.00	4.92	
4	其中:政策性金融债	10,944,000.00	4.92	
5	企业债券	-	-	
6	资产支持证券	-	-	
7	其他	-	-	
8	合计	216,467,283.49	100.00	

5.5 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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	23,088,680.00	10.67
2	其中:股票		