

博时颐泰混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

2019年6月30日
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:二〇一九年八月二十七日

重要提示
基金管理人博时基金管理有限公司不存在虚假记载、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法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2019年6月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证基金信息不存在虚假记载、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告由中财证券杂志刊登。

本报告自2019年7月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时颐泰混合
基金代码	002023
交易代码	002023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年07月23日
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
报告期末基金份额总额	16,164,483.41份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	博时颐泰混合A
下属分级基金的交易代码	002023
报告期末下两级基金份额总额	48,670,248.08份

2.2 基金产品说明

投资目标	以追求长期稳健增值为目的,通过资产配置与风险资产的动力配置和有效的组合管理,合理控制组合波动率。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将宏观、量化、基本面分析等多种与主动的积极策略相结合,利用组合优化技术,动态调整权益类资产与固定资产配置比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×15%+恒生综合指数收益率×5%+中债综合财富(总值)指数×80%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中等风险、中等收益的基金。

2.3 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	博时基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
姓名	孙绍顺	田国胜
联系地址/电话	0755-83160000 010-67595006	010-67595006
电子邮箱	service@boshifund.com	ttg101@ccb.com
传真/电话	95106688 0755-83160140	010-67595006 010-68275853

2.4 信息披露方式

披露基金半年度报告正文的互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

3.1 主要会计数据和财务指标

主要会计数据和财务指标	金额单位:人民币元
-------------	-----------

项目	报告期末(2019年1月1日至2019年6月30日)
----	----------------------------

3.1.1期间数据和指标	博时颐泰混合A	博时颐泰混合C
本期已实现收益	7,526,944.94	924,712.64
本期利润	9,850,524.94	1,224,703.00
加权平均基金份额本期利润	0.1416	0.1396
本基金加权平均基金份额	12,000	11,878

3.1.2期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	博时颐泰混合C
--------------	------------------	---------

期末可供分配基金份额总额	0.1392	0.1221
期末基金资产净值	67,027,066.91	8,284,038.41
期末基金份额净值	1.1660	1.1484

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。

期末可供分配利润指基金份额净值减去未分配利润中与未分配利润中已实现部分的孰低数。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用,计入使用后实际收益率将低于所列数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	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
----	---------	------------	-----------	--------------	-----	-----

过去一个月	3.36%	0.62%	1.50%	0.20%	1.66%	0.32%
过去三个月	-0.48%	0.61%	0.30%	0.25%	-0.78%	0.36%
过去六个月	12.64%	0.66%	0.88%	0.26%	6.28%	0.40%
自基金合同生效起	12.64%	0.54%	5.97%	0.27%	6.67%	0.27%

博时颐泰混合C	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	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
---------	---------	------------	-----------	--------------	-----	-----

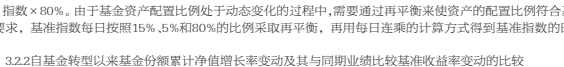
过去一个月	3.11%	0.62%	1.50%	0.20%	1.61%	0.32%
过去三个月	-0.01%	0.61%	0.30%	0.25%	-0.91%	0.36%
过去六个月	11.07%	0.66%	0.88%	0.26%	5.59%	0.40%
自基金合同生效起	12.00%	0.54%	5.97%	0.27%	6.00%	0.27%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×15%+恒生综合指数收益率×5%+中债综合财富(总值)指数×80%。由于本基金资产配置比例处于动态变动之中,需通过公允价值变动使资产净值与基金合同要求,长期来看,预计15%、5%和80%的比例会围绕中轴,而通过公允价值计算方式将业绩指数的时间序列。

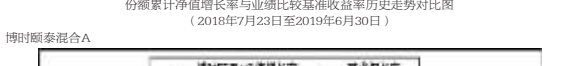
3.2.2 基金净值增长与业绩比较基准收益率变动对比

博时颐泰混合A	份额净值增长率	业绩比较基准收益率
---------	---------	-----------

份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2016年7月23日至2019年6月30日)



博时颐泰混合A



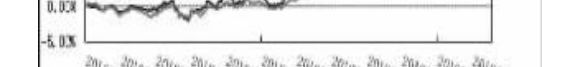
博时颐泰混合C



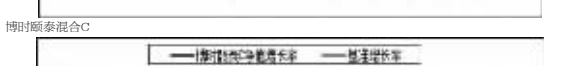
注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×15%+恒生综合指数收益率×5%+中债综合财富(总值)指数×80%。由于本基金资产配置比例处于动态变动之中,需通过公允价值变动使资产净值与基金合同要求,长期来看,预计15%、5%和80%的比例会围绕中轴,而通过公允价值计算方式将业绩指数的时间序列。

3.2.2 基金净值增长与业绩比较基准收益率变动对比

博时颐泰混合A	份额净值增长率	业绩比较基准收益率
---------	---------	-----------



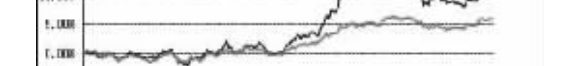
博时颐泰混合C



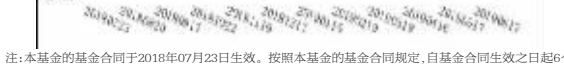
注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×15%+恒生综合指数收益率×5%+中债综合财富(总值)指数×80%。由于本基金资产配置比例处于动态变动之中,需通过公允价值变动使资产净值与基金合同要求,长期来看,预计15%、5%和80%的比例会围绕中轴,而通过公允价值计算方式将业绩指数的时间序列。

3.2.2 基金净值增长与业绩比较基准收益率变动对比

博时颐泰混合A	份额净值增长率	业绩比较基准收益率
---------	---------	-----------



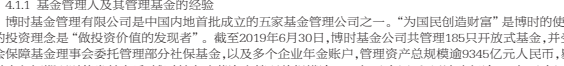
博时颐泰混合C



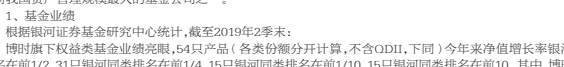
注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×15%+恒生综合指数收益率×5%+中债综合财富(总值)指数×80%。由于本基金资产配置比例处于动态变动之中,需通过公允价值变动使资产净值与基金合同要求,长期来看,预计15%、5%和80%的比例会围绕中轴,而通过公允价值计算方式将业绩指数的时间序列。

3.2.2 基金净值增长与业绩比较基准收益率变动对比

博时颐泰混合A	份额净值增长率	业绩比较基准收益率
---------	---------	-----------



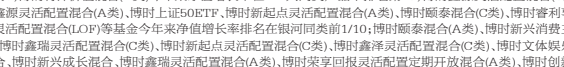
博时颐泰混合C



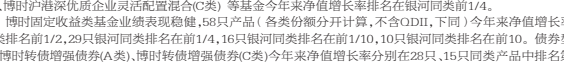
注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×15%+恒生综合指数收益率×5%+中债综合财富(总值)指数×80%。由于本基金资产配置比例处于动态变动之中,需通过公允价值变动使资产净值与基金合同要求,长期来看,预计15%、5%和80%的比例会围绕中轴,而通过公允价值计算方式将业绩指数的时间序列。

3.2.2 基金净值增长与业绩比较基准收益率变动对比

博时颐泰混合A	份额净值增长率	业绩比较基准收益率
---------	---------	-----------



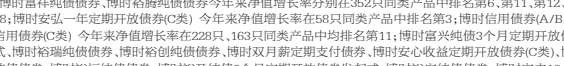
博时颐泰混合C



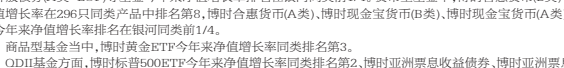
注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×15%+恒生综合指数收益率×5%+中债综合财富(总值)指数×80%。由于本基金资产配置比例处于动态变动之中,需通过公允价值变动使资产净值与基金合同要求,长期来看,预计15%、5%和80%的比例会围绕中轴,而通过公允价值计算方式将业绩指数的时间序列。

3.2.2 基金净值增长与业绩比较基准收益率变动对比

博时颐泰混合A	份额净值增长率	业绩比较基准收益率
---------	---------	-----------



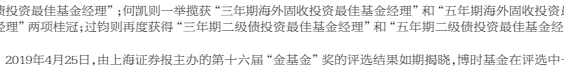
博时颐泰混合C



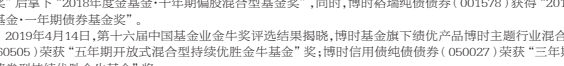
注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×15%+恒生综合指数收益率×5%+中债综合财富(总值)指数×80%。由于本基金资产配置比例处于动态变动之中,需通过公允价值变动使资产净值与基金合同要求,长期来看,预计15%、5%和80%的比例会围绕中轴,而通过公允价值计算方式将业绩指数的时间序列。

3.2.2 基金净值增长与业绩比较基准收益率变动对比

博时颐泰混合A	份额净值增长率	业绩比较基准收益率
---------	---------	-----------



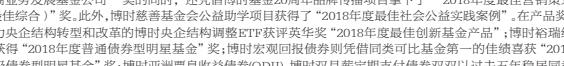
博时颐泰混合C



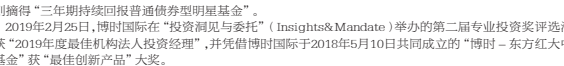
注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×15%+恒生综合指数收益率×5%+中债综合财富(总值)指数×80%。由于本基金资产配置比例处于动态变动之中,需通过公允价值变动使资产净值与基金合同要求,长期来看,预计15%、5%和80%的比例会围绕中轴,而通过公允价值计算方式将业绩指数的时间序列。

3.2.2 基金净值增长与业绩比较基准收益率变动对比

博时颐泰混合A	份额净值增长率	业绩比较基准收益率
---------	---------	-----------



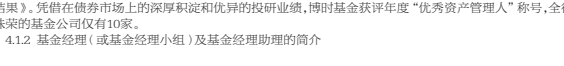
博时颐泰混合C



注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×15%+恒生综合指数收益率×5%+中债综合财富(总值)指数×80%。由于本基金资产配置比例处于动态变动之中,需通过公允价值变动使资产净值与基金合同要求,长期来看,预计15%、5%和80%的比例会围绕中轴,而通过公允价值计算方式将业绩指数的时间序列。

3.2.2 基金净值增长与业绩比较基准收益率变动对比

博时颐泰混合A	份额净值增长率	业绩比较基准收益率
---------	---------	-----------



博时颐泰混合C



博时颐泰混合型证券投资基金

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限
----	----	-----------------