

博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金

[2014] 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:中国农业银行股份有限公司
报告送达日期:2014年10月27日

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。

基金托管人和代销机构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。

基金过往业绩并不代表未来表现，投资需谨慎。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。

本基金报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称: 博时内需增长混合基金

基金代码: 000264

交易代码: 000264

基金份额运作方式: 灵活配置型开放式基金

基金合同生效日: 2013年7月15日

报告期末基金资产总额: 972,024,616.49元

投资目标: 在充分考虑风险与收益匹配的前提下投资股票，在严格控制投资风险的基础上，力争为基金份额持有人长期持续创造稳定的回报。

投资策略: 本基金将根据宏观经济形势、行业景气度、市场资金面、政策环境、估值水平以及国际市场走势等多方面因素综合分析，通过自上而下的资产配置，精选具有核心竞争力的行业，精选个股，力求在有效控制风险的情况下实现基金资产的保值增值。

业绩比较基准: 沪深300指数收益率×60%+债券指数收益率×40%

风险收益特征: 本基金主要投资于股票，因此其预期收益及预期风险水平高于股票型基金，属于高风险、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: 中国农业银行股份有限公司

§ 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(2014年7月1日~2014年9月30日)

1.本期已实现收益 9,725,600.21

2.本期利润 67,637,465.35

3.期初至报告期基金期间的利润 -0.108

4.期末基金资产净值 618,637,702.19

5.期末基金份额净值 1.008

注:本基金于2013年7月16日生效。本基金于2013年9月31日完成了基金份额的集中申购。按照本基金的基金合同约定，本基金在基金合同生效之日起六个月内不得从事股票投资，因此本基金在报告期内未进行股票投资。

本基金在报告期内对各项资产配置比例符合基金合同的规定。

§ 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间 证券从业年限 说明

王燕 基金经理/混合型投资总监 2013-7-15 - 10

王燕女士对报告期内本基金的管理情况进行了说明。

本基金在报告期内对各项资产配置比例符合基金合同的规定。

本基金在报告期内严格执行了《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。

4.2 异常交易行为的专项说明

本基金在报告期内不存在异常交易行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

3季度,在货币市场利率以及增值税的月份将启动的预期下,市场大幅反弹,上证指数跑赢中小板指数及创业板指。

从行业角度看,三季度表现最好的板块为国防军工、纺织服装、农林牧渔、表演服务、银行、煤炭、传媒等,在场面上涨幅居前。

本基金在第三季度的个股分散程度,相对于对风险收益比的考量,在一些主题概念的创业板个股布局不多,丧失了一定的获利机会。

4.4 基金的业绩表现

截至2014年9月30日,本基金份额净值为1.008元,累计份额净值为0.944元,报告期内的净值增长率为11.46%,同行业绩基准净值增长率为9.46%。

本基金在报告期内对各项资产配置比例符合基金合同的规定。

本基金在报告期内严格执行了《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。

4.5 投资组合报告

4.5.1报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金总资产的比例(%)

1 农林、渔业 - 5.42

2 采矿、有色金属 - 5.42

3 制造业 312,636,621.26 50.54

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 35,747,430.00 5.46

5 建筑业 24,719,419.06 4.00

6 批发、零售业 8,670,000.00 1.40

7 交通运输、仓储和邮政业 - -

8 银行 35,534,000.00 5.95

9 其他 - -

10 合计 448,860,444.56 72.56

4.5.2报告期末按行业分类的债券投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金总资产的比例(%)

1 国债 448,860,444.56 71.21

2 企业债 118,161,000.00 18.75

3 财政票据 116,160,000.00 18.75

4 短期融资券 - -

5 超短期融资券 - -

6 银行存款和结算备付金合计 38,049,189.69 6.04

7 其他资产 7,256,936.07 3.06

8 合计 630,336,570.32 100.00

4.5.3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 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 中国铝业 448,860,444.56 71.21

2 中国神华 448,860,444.56 71.21

3 中国国航 118,161,000.00 18.75

4 中国石化 116,160,000.00 18.75

5 中国交建 - -

6 中国国电 116,160,000.00 18.75

7 中国中车 116,160,000.00 18.75

8 中国建筑 116,160,000.00 18.75

9 中国中铁 116,160,000.00 18.75

10 中国国航 116,160,000.00 18.75

4.5.4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 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 国债 448,860,444.56 71.21

2 企业债 118,161,000.00 18.75

3 财政票据 116,160,000.00 18.75

4 短期融资券 - -

5 超短期融资券 - -

6 银行存款和结算备付金合计 38,049,189.69 6.04

7 其他资产 7,256,936.07 3.06

8 合计 630,336,570.32 100.00

4.5.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 金条 - -

2 银条 - -

3 其他 - -

4 合计 - -

4.5.6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股票投资组合

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 中国铝业 448,860,444.56 71.21

2 中国神华 448,860,444.56 71.21

3 中国国航 118,161,000.00 18.75

4 中国石化 116,160,000.00 18.75

5 中国交建 - -

6 中国国电 116,160,000.00 18.75

7 中国建筑 116,160,000.00 18.75

8 中国中铁 116,160,000.00 18.75

9 中国国航 116,160,000.00 18.75

10 中国国航 116,160,000.00 18.75

4.5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 国债 448,860,444.56 71.21

2 企业债 118,161,000.00 18.75

3 财政票据 116,160,000.00 18.75

4 短期融资券 - -

5 超短期融资券 - -

6 银行存款和结算备付金合计 38,049,189.69 6.04

7 其他资产 7,256,936.07 3.06

8 合计 630,336,570.32 100.00

4.5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 金条 - -

2 银条 - -

3 其他 - -

4 合计 - -

4.5.9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组合

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 中国铝业 448,860,444.56 71.21

2 中国神华 448,860,444.56 71.21

3 中国国航 118,161,000.00 18.75

4 中国石化 116,160,000.00 18.75

5 中国交建 - -

6 中国国电 116,160,000.00 18.75

7 中国建筑 116,160,000.00 18.75

8 中国中铁 116,160,000.00 18.75

9 中国国航 116,160,000.00 18.75

10 中国国航 116,160,000.00 18.75

4.5.10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组合

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 国债 448,860,444.56 71.21