

博时价值增长证券投资基金

[2015] 第一季度报告

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:2015年4月20日

基金管理人的单事项或董事正本件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、完整性和及时性承担法律责任。

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4月17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，保证复核后的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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	博时价值增长混合
基金主代码	050001
交易代码	050001(前端) 051001(后端)
基金份额运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年9月6日
报告期末基金份额总额	130,575,579.98份
投资目标	分享中国经济和资本市场的成长成就，谋求基金资产的长期稳定增长。
投资策略	本基金主要采用风格风险管理的多层次复合投资策略。
业绩比较基准	日本东京证券交易所股票指数×30%+深证成份股指数×30%+国债总指数×40%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的中等风险品种，在以风格为导向的前提下追求最大化的风险收益。
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

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	297,963,628.34
2.本期利润	881,884,977.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.0628
4.期末基金份额净值	11,837,305,891.76
5.期末基金净值增长率	0.905

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。

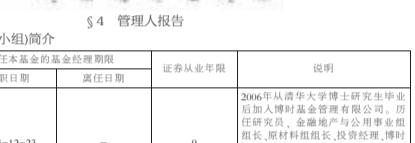
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期内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	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	8.00%	1.96%	10.37%	1.28%	-2.37%	0.68%

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



§ 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
韩茂华	基金经理	2014-12-23	-	9
黄国庆	股票投资部 量化投资部 总监/基金经理	2015-02-09	-	13

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

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、取信于市场的原则管理运用基金资产，使基金持有人最大限度地获得利益。本基金报告期内由于证券交易市场波动等原因，本基金出现个别投资决策指标超出了正常范围，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

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 报告期内本基金的投资组合情况

4.4.1 报告期末基金资产组合情况

4.4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

4.4.3 报告期末按公允价值占基金总资产比例大小排序的前十名股票投资明细

4.4.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

4.4.5 报告期末按公允价值占基金总资产比例大小排序的前五名债券投资明细

4.4.6 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前十名资产支持证券投资组合

4.4.7 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名贵金属投资明细

4.4.8 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名权证及衍生金融工具投资明细

4.4.9 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名买入返售金融资产投资明细

4.4.10 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收票据投资明细

4.4.11 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收股利投资明细

4.4.12 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应收款投资明细

4.4.13 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名买入返售金融资产投资明细

4.4.14 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名卖出回购金融资产逆回购款投资明细

4.4.15 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收利息投资明细

4.4.16 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收股利投资明细

4.4.17 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应付款投资明细

4.4.18 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名预收款项投资明细

4.4.19 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应付股利投资明细

4.4.20 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应付账款投资明细

4.4.21 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应付款投资明细

4.4.22 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名预付款项投资明细

4.4.23 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收保费投资明细

4.4.24 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应收款投资明细

4.4.25 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名买入返售金融资产投资明细

4.4.26 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名卖出回购金融资产逆回购款投资明细

4.4.27 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收利息投资明细

4.4.28 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收股利投资明细

4.4.29 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应付款投资明细

4.4.30 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名预收款项投资明细

4.4.31 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应付款投资明细

4.4.32 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名预付款项投资明细

4.4.33 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收保费投资明细

4.4.34 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应收款投资明细

4.4.35 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名买入返售金融资产投资明细

4.4.36 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名卖出回购金融资产逆回购款投资明细

4.4.37 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收利息投资明细

4.4.38 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收股利投资明细

4.4.39 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应付款投资明细

4.4.40 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名预收款项投资明细

4.4.41 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应付款投资明细

4.4.42 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名预付款项投资明细

4.4.43 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收保费投资明细

4.4.44 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应收款投资明细

4.4.45 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名买入返售金融资产投资明细

4.4.46 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名卖出回购金融资产逆回购款投资明细

4.4.47 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收利息投资明细

4.4.48 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收股利投资明细

4.4.49 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应付款投资明细

4.4.50 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名预收款项投资明细

4.4.51 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应付款投资明细

4.4.52 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名预付款项投资明细

4.4.53 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收保费投资明细

4.4.54 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应收款投资明细

4.4.55 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名买入返售金融资产投资明细

4.4.56 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名卖出回购金融资产逆回购款投资明细

4.4.57 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收利息投资明细

4.4.58 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收股利投资明细

4.4.59 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应付款投资明细

4.4.60 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名预收款项投资明细

4.4.61 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应付款投资明细

4.4.62 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名预付款项投资明细

4.4.63 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收保费投资明细

4.4.64 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应收款投资明细

4.4.65 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名买入返售金融资产投资明细

4.4.66 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名卖出回购金融资产逆回购款投资明细

4.4.67 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收利息投资明细

4.4.68 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名应收股利投资明细

4.4.69 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名其他应付款投资明细

4.4.70 报告期末按公允价值占基金净资产比例大小排序的前五名预收款项投资明细