

博时裕富沪深300指数证券投资基金

博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第二季度报告

【2015】第二季度报告

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7月18日

§1 重要提示

基金管理人及董事承诺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7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。
本报告自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时沪深300指数
基金代码	050002
交易代码	050002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年9月30日
截至期末基金份额总额	5,408,722,284.23份
投资目标	分享中国资本市场的长期增长。本基金将以对标的指数的长期投资为基本原则,通过科学的投资策略实现对股票指数投资目标,力争取得基金净值增长率在标的指数增长率的基础上正幅度在35%以上,并保持在跟踪误差在4%以下。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用被动式投资策略,使跟踪误差在标的指数的跟踪误差范围内,以最大限度、跟踪误差等风险控制指标对基金资产风险进行实时监控和管理。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为沪深300指数90%的跟踪收益率。
风险收益特征	本基金为被动式指数基金,其跟踪误差及跟踪风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币型基金,属于中低风险/风险特征基金。
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

主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	2,864,303,648.51
2.本期利润	1,664,502,144.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.2320
4.期末基金资产净值	7,430,189,373.92

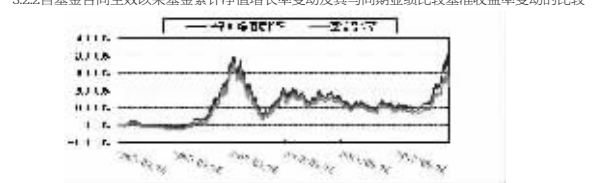
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	13.01%	25.0%	0.99%	2.40%	3.02%
过去六个月	13.01%	25.0%	0.99%	2.40%	3.02%

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



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理期限	证券从业年限	说明
赵卫	基金经理	2015-06-06	5	2002年毕业于中国政法大学,2003年加入博时基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理。2015年6月6日起担任博时沪深300指数证券投资基金基金经理。2015年6月6日起担任博时沪深300指数证券投资基金基金经理。2015年6月6日起担任博时沪深300指数证券投资基金基金经理。2015年6月6日起担任博时沪深300指数证券投资基金基金经理。
王红欣	指数投资助理/基金经理	2013-01-09	21	1994年毕业于北京理工大学,2003年加入博时基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理。2013年1月9日起担任博时沪深300指数证券投资基金基金经理。2013年1月9日起担任博时沪深300指数证券投资基金基金经理。2013年1月9日起担任博时沪深300指数证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵守了《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,并未被监管部门、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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,由于证券市场波动等原因,本基金曾出现个别投资指标超标的情况,基金管理人按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 报告期内基金投资策略和运作分析
回顾2015年上半年,货币政策全面转为宽松,央行多次降准降息,股市资金充裕。在赚钱效应的示范下,住户部门资金申购入市,各股指数全面上涨,尤其是在经济预期下,以创业板为代表的成长股表现,互联网、电子、计算机等行业股票涨幅较大。而以沪深300为代表的大盘蓝筹涨幅相对较小。在二季度末,受监管层防范场外配资融资等政策影响,主要股指大幅下跌,小盘股跌幅更重。市场的悲观情绪再度攀升。整个上半年股市走势呈现出先扬后抑、加速下跌的趋势。
在本报告期内,本基金在投资中遇到了较大挑战,增加了本基金的交易成本,增加了管理操作的难度。值得欣慰的是,本基金采取的组合策略和风险控制措施,在种不利的环境下,本基金在报告期内仍然获得了较为显著的超额收益,并且基金与基准的跟踪误差较小,收益风险比可控。从稳定性来看,上半年的96个月中,全部都战胜了基准,而且日胜率、周胜率较高,量化增强策略的整体效果符合预期。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金资产净值为1,737.7元,累计份额净值为1,263.7元,报告期内净值增长率为13.01%,同期业绩比较基准为0.99%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年下半年,货币政策可能进一步宽松,财政政策有望继续发力。宏观经济已有企稳回升态势。市场大部分的悲观预期已经充分反映,目前市场点位下具有较大的安全边际,部分低估价值蓝筹有望以估值优化和业绩提升获得投资机会。综合来看,下半年市场可能呈现震荡上行趋势。

4.7 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。

§5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	7,038,513,933.11	92.68
2	其中:股票	7,038,513,933.11	92.68
3	固定收益投资	584,622,880.20	7.77
4	其中:债券	134,522,880.20	1.77
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	其中:买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	264,439,118.36	3.48
9	其他各项资产	150,381,886.43	2.10
10	合计	7,598,987,828.09	100.00

5.2 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)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	20,223,110.07	0.27
B	采矿业	269,182,756.33	3.36
C	制造业	2,413,223,568.26	32.48
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	340,732,063.12	4.59
E	建筑业	328,570,308.58	4.43
F	交通运输、仓储和邮政业	247,086,438.83	3.33
G	信息传输、软件和信息技术服务业	289,350,546.41	3.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	金融业	2,328,568,282.34	31.34
J	房地产业	306,474,358.08	4.13
K	租赁和商务服务业	25,481,349.00	0.34
L	科学研究和技术服务业	16,922,380.04	0.23
M	水利、环境和公共设施管理业	4,933,446.00	0.07
N	教育、体育和娱乐业	-	-
O	文化、体育和娱乐业	134,913,467.98	1.82
P	合计	4,800,734.00	0.06
Q	合计	7,038,513,933.11	92.73

序号	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	4,007,300	33,326,921.04
2	600000	浦发银行	11,537,740	166,620,226.66
3	601166	兴业银行	10,911,567	188,224,530.75
4	600036	招商银行	9,992,100	187,062,112.00
5	600000	中信证券	5,895,136	108,330,782.85
6	600016	民生银行	16,776,630	156,809,762.20
7	600837	东方证券	6,286,284	136,644,588.00
8	600063	杨子光电	1,799,248	114,071,810.61
9	000002	万科A	7,546,826	109,565,270.00
10	601988	中国中铁	12,738,100	105,064,383.83

序号	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	4,007,300	33,326,921.04
2	600000	浦发银行	11,537,740	166,620,226.66
3	601166	兴业银行	10,911,567	188,224,530.75
4	600036	招商银行	9,992,100	187,062,112.00
5	600000	中信证券	5,895,136	108,330,782.85
6	600016	民生银行	16,776,630	156,809,762.20
7	600837	东方证券	6,286,284	136,644,588.00
8	600063	杨子光电	1,799,248	114,071,810.61
9	000002	万科A	7,546,826	109,565,270.00
10	601988	中国中铁	12,738,100	105,064,383.83

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	132,059,000.70	1.79
2	央行票据	-	-
3	金融债	-	-
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,063,799.50	0.02
8	合计	134,522,880.20	1.81

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五名债券投资明细					
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	019141	14国债14	510,000	51,020,400.00	0.69
2	019121	13国债21	300,000	30,171,000.00	0.41
3	120017	12国债17	300,000	30,075,000.00	0.40
4	019148	14国债18	100,000	10,024,000.00	0.13
5	019028	10国债28	65,370	6,544,100.00	0.09

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	2,938,740.07
2	应收证券清算款	16,044,776.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,963,591.93
5	应收申购款	136,434,779.43
6	其他应收款	-
7	预收账款	-
8	其他	-
9	合计	159,381,886.43

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	2,938,740.07
2	应收证券清算款	16,044,776.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,963,591.93
5	应收申购款	136,434,779.43
6	其他应收款	-
7	预收账款	-
8	其他	-
9	合计	159,381,886.43

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	2,938,740.07
2	应收证券清算款	16,044,776.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,963,591.93
5	应收申购款	136,434,779.43
6	其他应收款	-
7	预收账款	-
8	其他	-
9	合计	159,381,886.43

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	2,938,740.07
2	应收证券清算款	16,044,776.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,963,591.93
5	应收申购款	136,434,779.43
6	其他应收款	-
7	预收账款	-
8	其他	-
9	合计	159,381,886.43

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	2,938,740.07
2	应收证券清算款	16,044,776.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,963,591.93
5	应收申购款	136,434,779.43
6	其他应收款	-
7	预收账款	-
8	其他	-
9	合计	159,381,886.43

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	2,938,740.07
2	应收证券清算款	16,044,776.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,963,591.93
5	应收申购款	136,434,779.43
6	其他应收款	-
7	预收账款	-
8	其他	-
9	合计	159,381,886.43

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	2,938,740.07
2	应收证券清算款	16,044,776.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,963,591.93
5	应收申购款	136,434,779.43
6	其他应收款	-
7	预收账款	-
8	其他	-
9	合计	159,381,886.43

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	2,938,740.07
2	应收证券清算款	16,044,776.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,963,591.93
5	应收申购款	136,434,779.43
6	其他应收款	-
7	预收账款	-
8	其他	-
9	合计	159,381,886.43

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	2,938,740.07
2	应收证券清算款	16,044,776.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,963,591.93
5	应收申购款	136,434,779.43
6	其他应收款	-
7	预收账款	-
8	其他	-
9	合计	159,381,886.43

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	2,938,740.07
2	应收证券清算款	16,044,776.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,963,591.93
5	应收申购款	136,434,779.43
6	其他应收款	-
7	预收账款	-
8	其他	-
9	合计	159,381,886.43

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	2,938,740.07
2	应收证券清算款	16,044,776.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,963,591.93
5	应收申购款	136,434,779.43
6	其他应收款	-
7	预收账款	-
8	其他	-
9	合计	159,381,886.43

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	2,938,740.07
2	应收证券清算款	16,044,776.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,963,591.93
5	应收申购款	136,434,779.43
6	其他应收款	-
7	预收账款	-
8	其他	-
9	合计	159,381,886.43

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	2,938,740.07
2	应收证券清算款	16,044,776.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,963,591.93
5	应收申购款	136,434,779.43
6	其他应收款	-
7	预收账款	-
8	其他	-
9	合计	159,381,886.43

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	2,938,740.07
2	应收证券清算款	16,044,776.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,963,591.93
5	应收申购款	136,434,779.43
6	其他应收款	-
7	预收账款	-
8	其他	-
9	合计	159,381,886.43

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	2,938,740.07
2	应收证券清算款	16,044,776.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,963,591.93
5	应收申购款	136,434,779.43
6	其他应收款	-
7	预收账款	-
8	其他	-
9	合计	159,381,886.43

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	2,938,740.07
2	应收证券清算款	16,044,776.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,963,591.93
5	应收申购款	136,434,779.43