

信息披露 Disclosure

博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金

[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

基金管理人的董事会及监事会对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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年4月28日至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	博时互联网主题混合
基金主要代码	000125
交易代码	000125
基金所处分类	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月26日
报告期末基金份额总额	3,721,044,872.15份
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极挖掘成长行业和企业所蕴含的投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争为基金份额持有人创造价值。
投资策略	本基金主要通过对经济周期及资产价格变动变化的，通过定性和定量的方法分析宏观经济、货币市场、政策环境等各方面因数，建立基金经理对各大类资产收益的相对预期，进而作出对各大类资产配置权重的判断。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+债券收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期收益和预期风险低于股票型基金，高于货币市场基金和债券型基金，具有中高等风险/收益的特征。
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
单位:人民币元

报告期(2015年4月28日-基金合同生效日)-2015年6月30日)	
1.本期已实现收益	-363,689,906.99
2.本期利润	-613,873,656.74
3.期初至报告期基金总利润	-10,156.3
4.期末基金净值	3,137,257,974.38
5.期末基金份额净值	0.843

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-15.0%	2.97%	-3.55%	1.76%	-12.15%	1.21%

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

注:本基金合同于2015年4月28日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(四)投资限制的有关约定。

§ 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
招杨	基金经理	2015-04-28	-	8
黎雪川	基金经理	2015-04-28	-	6

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循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、基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、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋取最大利益。本报告期内，基金管理投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平公正交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金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

因为政府对多层次资本市场的布局和决心，导致创新型企业从多种渠道获得融资的门槛大幅度降低，例如新三板挂牌将到来的注册制，同时一批正在拆除VIE结构将登陆国内的创新型企业，都对A股现有的互联网概念或者转型公司不管是从并购还是对比的角度，都形成了种种估值压力。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日，本基金份额净值为0.843元，份额累计净值为0.843元，报告期内净值增长率为-15.0%，同期业绩基准涨幅为-3.55%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来在新的创新型互联网企业将逐渐分化，强者恒强，过去互联网概念黄袍加身就能点石成金的时代过去了，大浪淘沙的时代来临，互联网仍然在改变我们的生活和工作方式，但是脱离地心引力的东西终归要回日本质。

未来一个季度的市场更多可能是重实质，重业绩，轻概念，市场的狂热期已经过去，放弃幻想，精挑细选。

4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,864,986,879.12	62.89
其中:股票		2,864,986,879.12	62.89
2 固定收益投资		-	-
3 货币市场工具		-	-
4 资产支持证券		-	-
5 货币衍生品投资		-	-
6 买入返售金融资产		-	-
其中:买断式回购的买入返售金融资产		-	-
7 其他资产		1,681,830,074.34	36.92
8 合计		4,555,835,145.64	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

单位:人民币元

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	169,321,655.87	5.40	
B 采矿业	-	-	
C 制造业	1,508,984,937.55	48.10	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-	
E 建筑业	-	-	
F 批发和零售业	-	-	
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-	
H 餐饮和住宿业	-	-	
I 信息传输、软件和信息技术服务业	1,062,214,290.21	33.86	
J 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	74,628,295.41	2.38	
O 居民服务、修理和其他服务业	-	-	
P 教育	-	-	
Q 卫生和社会工作	-	-	
R 文化、体育和娱乐业	49,817,070.08	1.59	
S 综合	-	-	
合计	2,864,986,879.12	91.32	

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	000059	东方财富	4,099,921	283,900,015.89	9.05
2	002268	卫士通	2,049,921	206,345,668.94	6.39
3	600884	鹏博士	5,999,994	179,159,820.84	5.71
4	002550	旋极信息	167,999,171.20	5.35	
5	300341	暴风科技	152,221,163.40	4.85	
6	300281	金利华电	142,352,942.16	4.54	
7	300309	腾邦国际	79,246	130,830,620.04	4.17
8	600104	永鼎股份	51,866,830	118,052,250.80	3.76
9	002450	康得新	33,493,830	102,504,790.00	3.27
10	002084	同花顺	29,099,421	100,796,592.00	3.21

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	面值(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	3,910,574,633.74	3,910,574,633.74	85.99
2	企业债	200,343,668.94	200,343,668.94	4.39
3	公司债	152,221,163.40	152,221,163.40	4.17
4	短期融资券	33,493,830	33,493,830	0.90
5	资产支持证券	5,999,994	5,999,994	0.16
6	次级债	-	-	-
7	可转换债券	-	-	-
8	其他	-	-	-
9	合计	3,910,574,633.74	3,910,574,633.74	100.00

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	贵金属品种	面值(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

<tbl_r cells="5" ix="1" maxcspan="1" maxrspan="1