

## 博时价值增长证券投资基金

[2015] 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:中国建设银行股份有限公司

报告期出日期:二〇一五年七月二十六日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及董事会秘书报告书不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质的真性、准确性、准确性和完整性承担个别法律责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等信息，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。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称:博时价值增长混合

基金代码:660001

基金名称:660001 (前端)

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2002年10月1日

报告期末基金份额总额:6,564,814.17610份

投资目标:分享中国经济和资本市场的高成长，谋求基金资产的长期稳健增长。

投资策略:本基金将通过风险预算管理多层次分散投资策略。

本基金将通过风险预算管理多层次分散投资策略。

日本基金成立日至2006年9月31日，本基金的业绩比较基准为价值增长指数，自2006年10月1日起本基金的业绩比较基准更改为：70%×深证综指指数收益率+30%×中国债券指数。

风险收益特征:本基金属于股票型基金中的中等风险品种，在风险约束下追求收益最大化为特点，在收益上追求下跌风险有下界，上涨收益无上限的目标。

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期实现收益 159,884,121.37

2.本期利润 -1,464,442,208.81

3.期初至报告期基金利润 -2,205.06

4.期末基金净资产值 5,110,569,026.05

5.期末基金份额净值 0.7930

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。

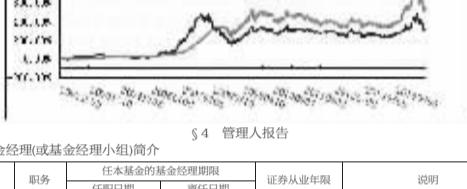
5.3 主要财务指标和基金净值表现

5.3.1 本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 (%) 累计净值增长 率 (%) 收益率标准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -21.84% 26.51% -10.72% 2.34% -2.12% 0.17%

5.3.2 本基金成立以来收入效应基金累计净值增长率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

韩晓华 基金经理 2014-12-23 - 9 2006年从清华大学博士研究生毕业，获经济学硕士学位。2006年7月至2013年6月就职于国泰基金管理有限公司，担任研究员、基金经理助理，负责消费行业研究；2013年6月加入本公司，担任研究员、基金经理助理，负责消费行业研究；现任基金经理，同时兼任博时基金管理有限公司基金经理，同时兼任博时基金管理有限公司基金经理。

5.11.11 本基金持有的前十名股票的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到处罚的，基金管理人没有进行说明。

5.11.12 本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.13 其他各项资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 1,943,725.10

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 31,027,681.13

5 应收申购款 173,474.59

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 33,144,890.82

5.11.14 报告期内持有的处于转让阶段的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有该类债券。

5.11.15 报告期内前十名股票中存在流通受限情况的说明

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(%) 流通受限情况说明

1 600013 招商银行 261,156,334.00 5.15 重仓股票停牌

2 000098 钢研高纳 142,267,197.36 2.78 重大资产重组停牌

3 600560 五粮液 6,564,814.17 1.10

5.11.16 给投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计数之间可能存在尾差。

5.6 放式基金份额变动

单位:份

序号 项目 金额(元)

1 权益投资 6,894,449,963.11

2 固定收益投资 613,126,942.71

3 货币市场基金 392,771,627.72

4 期权投资 -

5 报告期期末基金份额总额 6,564,814,170.00

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他各项实施细则，本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则，履行了信息披露义务，没有损害基金持有人利益的行为。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金的金额，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.3 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.4 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.5 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.6 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.7 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.8 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.9 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.10 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.11 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.12 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.13 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.14 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.15 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.16 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.17 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.18 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.19 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.20 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.21 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.22 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.23 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.24 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.25 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.26 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.27 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.28 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.29 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.30 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.31 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.32 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.33 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.34 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.35 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.36 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.37 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.38 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.39 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.40 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.41 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.42 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.43 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.44 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.45 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.46 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.47 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.48 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.49 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.50 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.51 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.52 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.53 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.54 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.55 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.56 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.57 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.58 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.59 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.60 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.61 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.62 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.63 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.64 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.65 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.66 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.67 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.68 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.69 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.70 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.71 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.72 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.73 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.74 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.75 基金管理人运用固有资金投资的金融衍生品，不存在超过法律法规规定比例的情形。

7.76 基金管理人运用固有资金投资的关联交易。

7.77 基金管理