

## 博时创业成长混合型证券投资基金

[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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年十月二十六日

## § 1 重要提示

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月23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：博时创业成长混合

基金代码：060014

交易代码：060014（前端） 061014（后端）

基金合同生效日：2010年6月1日

报告期末基金份额总额：194,038,347.0份

本基金通过深入研究创业板成长型公司，挖掘该类公司的投资机会，力争为基金持有人创造价值。

投资目标：本基金通过深入研究创业板成长型公司，挖掘该类公司的投资机会，力争为基金持有人创造价值。

本基金主要投资于创业板成长型公司，投资策略主要体现在：在股票投资的宏观层面上，本基金将结合宏观经济运行情况，通过分析宏观经济指标，判断宏观经济运行趋势，从而决定投资方向；在个股选择上，本基金将通过深入研究创业板成长型公司，从多角度判断公司价值，同时加强公司实际控制，尽可能地降低投资风险。

业绩比较基准：中证200指数收益率×75%+中证债券总指数收益率×25%。

风险收益特征：本基金属混合型基金，属于中等风险收益品种。

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

单位：人民币元

报告期：(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益：-14,234,994.14

2.本期利润：-110,988,823.22

3.加权平均基金份额本期利润：-0.05717

4.期末基金份额净值：271,400,676.09

5.期末资产净值：129.99

注：本公司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。

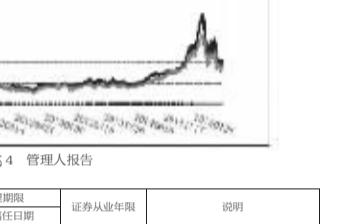
所述基金业绩效指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数据。

## 3.2 基金净值表现

3.2.1 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	净增长收益率①	净值增长收益率②	业绩比较基准收益率③	差值④	①-③	②-④
过去三个月	-27.06%	4.88%	-23.39%	2.97%	-367%	1.91%

3.2.2 日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(或基金经理助理)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	离任日期	证券从业年限	说明
韩茂华	基金经理	2013-08-26	-	9	2006年从清华大学博士生毕业后就职于国泰君安证券有限公司，历任研究员、金融产品与公用事业组组长、研究部助理总经理、研究总监，期间负责过国泰君安证券、国泰君安国际、国泰君安资产管理、国泰君安资本管理、国泰君安创新资本管理、国泰君安期货等多家子公司。2013年8月加入本公司，担任基金经理，现任本基金基金经理兼国泰君安证券投资基金基金经理兼国泰君安量化投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵守守信情况的说明

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》及其他各项实施细则，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、取信于社会的原则管理和运用基金财产，努力为持有人谋求最大利益。本基金报告期内，由于证券交易市场波动等因素，本基金会出现个别投资监控指标超标的状况，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 公平交易专户的情况

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不公平交易行为。

4.4 报告期内基金的投资组合和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金的资产配置策略和运作分析

4.4.2 报告期内基金的定期报告和临时报告

4.5 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	权杖投资	246,997,393.28	90.07
其中：股票		246,997,393.28	90.07
2 固定收益投资		-	-
其中：债券		-	-
货币市场基金		-	-
3 贵金属投资		-	-
4 金融衍生品投资		-	-
5 其他资产		-	-
6 银行存款和结算备付金合计	26,008,089.39	9.93	
7 其他各项资产	1,096,158.27	0.40	
8 合计	272,101,631.94	100.00	

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金的基金合同于2010年7月27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六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第11条“二、投资范围”、“六、投资限制”的有关约定。本基金建仓结束时各资产配置比例符合基金合同约定。

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名：韩茂华

职务：基金经理

任职日期：2013-08-26

离任日期：-

证券从业年限：135

说明：2006年从清华大学博士生毕业后就职于国泰君安证券有限公司，历任研究员、金融产品与公用事业组组长、研究部助理总经理、研究总监，期间负责过国泰君安证券、国泰君安国际、国泰君安资产管理、国泰君安资本管理、国泰君安创新资本管理、国泰君安期货等多家子公司。2013年8月加入本公司，担任基金经理，现任本基金基金经理兼国泰君安证券投资基金基金经理兼国泰君安量化投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵守守信情况的说明

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》及其他各项实施细则，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、取信于社会的原则管理和运用基金财产，努力为持有人谋求最大利益。本基金报告期内，由于证券交易市场波动等因素，本基金会出现个别投资监控指标超标的状况，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 公平交易专户的情况

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不公平交易行为。

4.4 报告期内基金的投资组合和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金的资产配置策略和运作分析

4.4.2 报告期内基金的定期报告和临时报告

4.5 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	权杖投资	217,569,508.87	80.32
其中：普通股		217,569,508.87	80.32
2 固定收益投资		-	-
其中：债券		-	-
货币市场基金		-	-
3 贵金属投资		-	-
4 金融衍生品投资		-	-
5 其他资产		-	-
6 银行存款和结算备付金合计	269,675,651.09	9.97	
7 其他各项资产	1,096,158.27	0.40	
8 合计	270,361,260.24	100.00	

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金的基金合同于2010年7月27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六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第11条“二、投资范围”、“六、投资限制”的有关约定。本基金建仓结束时各资产配置比例符合基金合同约定。

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名：张溪凤

职务：基金经理

任职日期：2011-08-28

离任日期：-

证券从业年限：135

说明：2001年先后在国泰君安证券有限公司、深圳市和风投资有限公司担任过项目经理、投资经理、投资总监等职务，2006年进入鹏华基金管理有限公司，历任研究员、行业组组长、基金经理，现任本基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵守守信情况的说明

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》及其他各项实施细则，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、取信于社会的原则管理和运用基金财产，努力为持有人谋求最大利益。本基金报告期内，由于证券交易市场波动等因素，本基金会出现个别投资监控指标超标的状况，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 公平交易专户的情况

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不公平交易行为。

4.4 报告期内基金的投资组合和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金的资产配置策略和运作分析

4.4.2 报告期内基金的定期报告和临时报告

4.5 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	权杖投资	217,569,508.87	80.32
其中：普通股		217,569,508.87	80.32
2 固定收益投资		-	-
其中：债券		-	-
货币市场基金		-	-
3 贵金属投资		-	-
4 金融衍生品投资		-	-
5 其他资产		-	-
6 银行存款和结算备付			