

博时新策略灵活配置混合型证券投资基金

[2016] 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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十二日

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。

基金托管人和银行份额有限公司根据本基金合同规定，于2016年4月21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未来表现。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2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金基本情况	
基金名称	博时新策略灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	博时新策略
基金主代码	200612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年1月21日
报告期末基金资产总额	人民币1,000.00亿元
报告期末基金份额总额	人民币1,000.00亿份
报告期末基金份额净值	人民币1.00元
报告期末可供分配基金份额总额	人民币0.00亿元
报告期末基金资产净值	人民币1,000.00亿元
报告期末基金份额净值	人民币1.00元

§ 3 主要财务指标及基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日至2016年3月31日)	
	报告期	报告期初至报告期末
1.本期已实现收益	279,425.36	1,432,405.00
2.本期利润	1,091,300.36	2,000,380.00
3.加权平均基金份额利润率	0.097%	0.017%
4.期末可供分配基金份额利润	0.0013	-
5.期末基金资产净值	1,001,300.36	-
6.期末基金份额净值	1.0013	-
7.期末可供分配基金份额总额	0.0013	-
8.期末基金资产净值总额	1,000,000.00	-
9.期末基金份额总份额	1,000,000.00	-
10.期末基金资产净值占份额净值比例	1.00	-

注:本期未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,本期费用为本期已实现收益加上本期基金公允价值变动收益。

所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价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

1.博时新策略混合A:

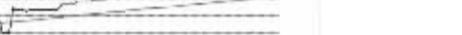
阶段	净申购金额	净赎回金额	净值比较基准	业绩比较基准收益率	期间实际收益率
过去三个月	100%	0.0%	0.0%	0.0%	1.0%

2.博时新策略混合C:

阶段	净申购金额	净赎回金额	净值比较基准	业绩比较基准收益率	期间实际收益率
过去三个月	100%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%

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

1.博时新策略混合A:



2.博时新策略混合C:



注:C类份额于2016年3月11日全部赎回,自3月14日起,本基金C类无份额,累计份额净值增长率保持不变。

注:本基金合同于2010年11月22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个月内基金的投资组合比例符合基金合同第十二部分“(二)投资范围”、“(四)投资限制”的有关规定。本报告期本基金基金建仓尚未结束。

1.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	性别	担任本基金基金经理的日期	证券从业年限	说明
王德生	男	2010年11月21日	11年	王德生先生,经济学学士,具有基金从业资格,并取得中国证券投资基金业协会颁发的基金从业资质证书,现任公司研究部总监,同时担任公司旗下多只基金的基金经理。

4.2 报告期内本基金运作合规性情况说明

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、本基金合同和其他相关法律规定的规范,并本着诚实信用、勤勉尽责,取信于市场,取信于社会的原则

管理运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金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 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

年初至今,沪深300创业板等指数最大跌幅曾到30%附近;市场风险偏好一度降到很低的水平,随着汇率稳定、信贷数据陆续发布,市场对注册制、战略新兴产业的预期,近期风险偏好逐步提升,后续需要继续观察汇率、通胀、货币政策及财政政策、国企改革的兑现情况。从时点来看,近期为年报、一季报披露高峰期,我们从中筛选出一批增长稳定性较高的公司进行配置,以期获取绝对收益。

4.5 报告期内基金的绩效表现

截至2016年3月31日,本基金A类份额净值为1.032元,累计份额净值为1.032元,报告期内净值增长率为1.88%,同期业绩基准涨幅为1.12%;C类份额净值为1.028元,累计份额净值为1.028元,报告期净值增长率为1.88%,同期业绩基准涨幅为0.88%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来市场,我们将密切关注资本市场制度变化的趋势,采取合适的投资策略,结合风险控制,保持基金产品的灵活性,为投资者带来合理的收益水平。

4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预说明

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)	占基金资产的比例(%)
1	股票投资	24,361,233.00	4.0%
2	债券投资	24,361,233.00	4.0%
3	货币市场基金投资	61,201,362.00	12.21
4	银行存款	61,201,362.00	12.21
5	其他资产	-	-
6	应收申购款	-	-
7	应收赎回款	-	-
8	应收证券清算备付金	-	-
9	应收保证金	-	-
10	应收利息	260,000,000.00	70.07
11	买入返售金融资产	34,384,280.00	0.64
12	应收申购款	1,072,308.14	0.02
13	其他应收款	602,109,406.00	100.00
14	合计	962,109,406.00	100.00

注:本基金合同于2010年1月11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3个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“(二)投资范围”、“(四)投资限制”的有关规定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

5.2 基金产品概况

5.2.1 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

1.博时新策略混合A:

阶段	净申购金额	净赎回金额	净值比较基准	业绩比较基准收益率	期间实际收益率
过去三个月	0.0%	0.0%	1.12%	0.02%	-0.42%

2.博时新策略混合C:

阶段	净申购金额	净赎回金额	净值比较基准	业绩比较基准收益率	期间实际收益率
过去三个月	0.0%	0.0%	1.12%	0.02%	-0.42%

5.2.2 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

1.博时新策略混合A:



2.博时新策略混合C:



注:本基金合同于2010年3月24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3个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“(二)投资范围”、“(四)投资限制”的有关规定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

1.博时新策略混合A:

阶段	净申购金额	净赎回金额	净值比较基准	业绩比较基准收益率	期间实际收益率
过去三个月	0.0%	0.0%	1.12%	0.02%	-0.42%

2.博时新策略混合C:

<tbl_struct