

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

§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法律责任。

基金托管人招商银行股份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。

本报告中期财务资料未经审计。

本报告自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称	博时新策略灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	081024
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月23日
基金募集总额/募集户数	889,141,429.07份
投资目标	本基金通过多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金通过多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。
业绩比较基准	中证500指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平高于债券型基金，低于股票型基金及货币型基金，属于中等风险收益特征。
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
下属基金的投资范围	博时新策略灵活配置混合型证券投资基金
下属基金的投资范围	博时新策略灵活配置混合型证券投资基金
报告期末下属基金的投资范围	博时新策略灵活配置混合型证券投资基金

3.1 主要财务指标

主要财务指标	本报告期(2016年1月1日至2016年3月31日)	本报告期(2016年1月1日至2016年3月31日)
1.本期已实现收益	279,108.38	4,424,488.08
2.本期利润	1,041,309.35	3,106,390.80
3.本期基金份额净值增长率	0.00%	0.00%
4.本期基金份额净值增长率	0.00%	0.00%
5.本期基金份额净值增长率	0.00%	0.00%

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

1. 博时新策略灵活配置

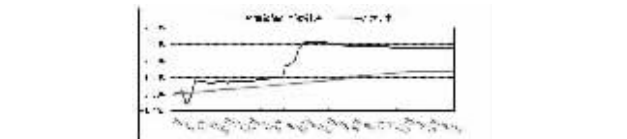
期间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
最近1个月	1.00%	0.10%	1.12%	0.02%	0.70%	0.08%

2. 博时新策略灵活配置C

期间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
最近1个月	1.00%	0.10%	0.88%	0.02%	1.00%	0.10%

3.2.2 本基金自生效之日起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. 博时新策略灵活配置A：



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为0。

注：本基金合同于2016年11月23日生效，按照本基金的基金合同约定，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基金合同第十二部分“（二）投资范围”、“（四）投资限制”的有关约定。本报告期末本基金投资组合未达规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	国籍	任职日期	简历介绍	证券从业年限	期间
王鹏	中国	2015-11-23	2015年11月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11月23日起任博时新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年11月23日起任博时新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年11月23日起任博时新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	7.7	

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明
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、本基金基金合同及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，为基金份额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律法规和基金合同的规定，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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。

4.3.1 公平交易执行的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.2 公平交易执行的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

年初至今，沪深300、创业板等指数涨跌幅曾到30%附近，市场风险偏好一度降到很低水平，随着汇率稳定、信贷数据持续发布、市场对注册制、战略新兴产业预期的变化，近期风险偏好逐步提升，后续需要继续观察汇率、通胀、货币政策及基建投资、国企改革等的实现情况。从总体来看，近期为年报、一季报报告披露期，我们从中筛选出一批成长性确定性较高的公司进行配置，以期获取绝对收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2016年3月31日，本基金A类基金份额净值为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0.88%。

4.6 管理人对于宏观经济、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，保持基金仓位的有效性，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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	24,361,203.28	4.88
2	固定收益	24,361,203.28	4.88
3	货币资金	61,251,302.89	12.21
4	买入返售金融资产	61,251,302.89	12.21
5	其他资产	61,251,302.89	12.21
6	其他负债	300,000,000.00	76.67
7	资产减值准备	34,944,286.64	6.94
8	其他资产	1,672,000,000.00	33.33
9	合计	1,889,141,429.07	377.80

§6 基金产品概况

基金名称	博时新策略灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	081024
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月23日
基金募集总额/募集户数	889,141,429.07份
投资目标	本基金通过多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金通过多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。
业绩比较基准	中证500指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平高于债券型基金，低于股票型基金及货币型基金，属于中等风险收益特征。
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
下属基金的投资范围	博时新策略灵活配置混合型证券投资基金
下属基金的投资范围	博时新策略灵活配置混合型证券投资基金
报告期末下属基金的投资范围	博时新策略灵活配置混合型证券投资基金

3.1 主要财务指标

主要财务指标	本报告期(2016年1月1日至2016年3月31日)	本报告期(2016年1月1日至2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-289,000.00	5,488,248.08
2.本期利润	1,041,309.35	3,106,390.80
3.本期基金份额净值增长率	0.00%	0.00%
4.本期基金份额净值增长率	0.00%	0.00%
5.本期基金份额净值增长率	0.00%	0.00%

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

1. 博时新策略灵活配置

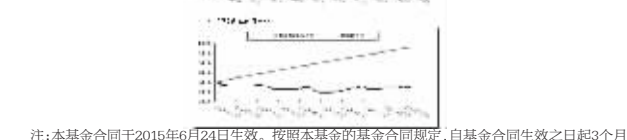
期间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
最近1个月	0.00%	0.00%	1.12%	0.02%	0.62%	0.00%

2. 博时新策略灵活配置C

期间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
最近1个月	0.00%	0.00%	0.88%	0.02%	0.88%	0.00%

3.2.2 本基金自生效之日起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. 博时新策略灵活配置A：



注：本基金合同于2016年6月24日生效，按照本基金的基金合同约定，自基金合同生效之日起3个月内使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”的有关约定。本基金建仓结束后各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	国籍	任职日期	简历介绍	证券从业年限	期间
王鹏	中国	2015-11-23	2015年11月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11月23日起任博时新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年11月23日起任博时新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年11月23日起任博时新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	7.7	

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明
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、本基金基金合同及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，为基金份额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律法规和基金合同的规定，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.2 异常交易发现的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

年初至今，沪深300、创业板等指数涨跌幅曾到30%附近，市场风险偏好一度降到很低水平，随着汇率稳定、信贷数据持续发布、市场对注册制、战略新兴产业预期的变化，近期风险偏好逐步提升，后续需要继续观察汇率、通胀、货币政策及基建投资、国企改革等的实现情况。从总体来看，近期为年报、一季报报告披露期，我们从中筛选出一批成长性确定性较高的公司进行配置，以期获取绝对收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2016年3月31日，本基金A类基金份额净值为1.004元，份额累计净值为1.004元；C类基金份额净值为0.996元，份额累计净值为0.996元。报告期内，本基金A类基金份额净值增长率为0.70%，C类基金份额净值增长率为0.20%，同期业绩基准增长率为1.12%。

4.6 管理人对于宏观经济、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，保持基金仓位的有效性，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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	106,000,000.00	6.29
2	固定收益	106,000,000.00	6.29
3	货币资金	59,429,703.21	3.54
4	买入返售金融资产	59,429,703.21	3.54
5	其他资产	59,429,703.21	3.54
6	其他负债	300,000,000.00	18.18
7	资产减值准备	34,944,286.64	2.11
8	其他资产	1,672,000,000.00	10.00
9	合计	1,889,141,429.07	100.00

§6 基金产品概况

基金名称	博时新策略灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	081024
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月23日
基金募集总额/募集户数	889,141,429.07份
投资目标	本基金通过多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金通过多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。
业绩比较基准	中证500指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平高于债券型基金，低于股票型基金及货币型基金，属于中等风险收益特征。
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
下属基金的投资范围	博时新策略灵活配置混合型证券投资基金
下属基金的投资范围	博时新策略灵活配置混合型证券投资基金
报告期末下属基金的投资范围	博时新策略灵活配置混合型证券投资基金

3.1 主要财务指标

主要财务指标	本报告期(2016年1月1日至2016年3月31日)	本报告期(2016年1月1日至2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-289,000.00	5,488,248.08
2.本期利润	1,041,309.35	3,106,390.80
3.本期基金份额净值增长率	0.00%	0.00%
4.本期基金份额净值增长率	0.00%	0.00%
5.本期基金份额净值增长率	0.00%	0.00%

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

1. 博时新策略灵活配置

期间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
最近1个月	0.00%	0.00%	1.12%	0.02%	0.62%	0.00%

2. 博时新策略灵活配置C

期间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
最近1个月	0.00%	0.00%	0.88%	0.02%	0.88%	0.00%

3.2.2 本基金自生效之日起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. 博时新策略灵活配置A：

注：本基金合同于2016年6月24日生效，按照本基金的基金合同约定，自基金合同生效之日起3个月内使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”的有关约定。本基金建仓结束后各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	国籍	任职日期	简历介绍	证券从业年限	期间
王鹏	中国	2015-11-23	2015年11月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11月23日起任博时新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年11月23日起任博时新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年11月23日起任博时新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	7.7	

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明
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、本基金基金合同及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，为基金份额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律法规和基金合同的规定，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.3.2 异常交易发现的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

年初至今，沪深300、创业板等指数涨跌幅曾到30%附近，市场风险偏好一度降到很低水平，随着汇率稳定、信贷数据持续发布、市场对注册制、战略新兴产业预期的变化，近期风险偏好逐步提升，后续需要继续观察汇率、通胀、货币政策及基建投资、国企改革等的实现情况。从总体来看，近期为年报、一季报报告披露期，我们从中筛选出一批成长性确定性较高的公司进行配置，以期获取绝对收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2016年3月31日，本基金A类基金份额净值为1.004元，份额累计净值为1.004元；C类基金份额净值为0.996元，份额累计净值为0.996元。报告期内，本基金A类基金份额净值增长率为0.70%，C类基金份额净值增长率为0.20%，同期业绩基准增长率为1.12%。

4.6 管理人对于宏观经济、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，保持基金仓位的有效性，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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	106,000,000.00	6.29
2	固定收益	106,000,000.00	6.29
3	货币资金	59,429,703.21	3.54
4	买入返售金融资产	59,429,703.21	3.54
5	其他资产	59,429,703.21	3.54
6	其他负债	300,000,000.00	18.18
7	资产减值准备	34,944,286.64	2.11
8	其他资产	1,672,000,000.00	10.00
9	合计	1,889,141,429.07	100.00

§6 基金产品概况

基金名称	博时新策略灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	081024
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月23日
基金募集总额/募集户数	889,141,429.07份
投资目标	本基金通过多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金通过多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。
业绩比较基准	中证500指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平高于债券型基金，低于股票型基金及货币型基金，属于中等风险收益特征。
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
下属基金的投资范围	博时新策略灵活配置混合型证券投资基金
下属基金的投资范围	博时新策略灵活配置混合型证券投资基金
报告期末下属基金的投资范围	博时新策略灵活配置混合型证券投资基金

3.1 主要财务指标

主要财务指标	本报告期(2016年1月1日至2016年3月31日)	本报告期(2016年1月1日至2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-289,000.00	5,488,248.08
2.本期利润	1,041,309.35	3,106,390.80
3.本期基金份额净值增长率	0.00%	0.00%
4.本期基金份额净值增长率	0.00%	0.00%
5.本期基金份额净值增长率	0.00%	0.00%

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