

博时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:中国建设银行股份有限公司
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，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财产，但不保证基金一定盈利。
基金管理人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。
本基金报告中财务资料未经审计。

本报告日期至2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	博时策略灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	069012
交易代码	069012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年9月11日
报告期末基金份额总额	404,011,754.00份
投资目标	通过运用多样化的投资策略，在投资组合中合理配置资产，并对成长、价值风格进行的股票进行行业配置，以求获得长期稳健收益。
投资策略	本基金将通过上下逐层的行业配置和，定价分析和估值分析互补的方法，在严格控制风险的前提下，通过行业配置和个股精选，精选出具有估值吸引力的股票，通过行业配置，以期获得长期稳健的收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*60%+中债国债指数收益率*40%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高风险，较高收益的品种。
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

单位:人民币元

报告期(2016年1月1日-2016年3月31日)

1.本期已实现收益 -96,228,029.09

2.本期利润 -90,422,241.24

3.本期基金份额本期利润 -0,3447

4.期末基金份额净值 0.6976

5.期末可供分配基金份额利润 1.801

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，本期利润指本期利息收入、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

前阶段 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

过去六个月 -17.89% 2.43% -7.09% 1.40% -9.98% 0.07%

3.2.2 本报告期基金份额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:本基金成立以来以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

3.3 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2016年1月1日-2016年3月31日)

1.本期已实现收益 -96,228,029.09

2.本期利润 -90,422,241.24

3.本期基金份额本期利润 -0,3447

4.期末基金份额净值 0.6976

5.期末可供分配基金份额利润 1.801

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，本期利润指本期利息收入、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。

3.4 管理人报告

3.4.1 公平交易专项说明

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》及公司制定的公平交易制度，公平对待所管理的不同基金，不存在利用基金交易机会进行利益输送、不公平对待所管理的不同基金的情况。

3.4.2 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。

3.4.3 报告期内基金投资组合情况

3.4.3.1 本报告期末按行业分类的股票投资组合

3.4.3.2 本报告期末按行业分类的债券投资组合

3.4.3.3 本报告期末按行业分类的资产支持证券投资组合

3.4.3.4 本报告期末按行业分类的黄金衍生品投资组合

3.4.3.5 其他

3.4.3.6 合计

3.4.4 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

3.4.5 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债券投资明细

3.4.6 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资产支持证券投资明细

3.4.7 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

3.4.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资

3.4.9 报告期末按资产支持证券投资品种分类的资产支持证券情况

3.4.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

3.4.11 报告期末持有的暂时停牌股票

3.4.12 报告期末持有的因临时停牌无法卖出的股票

3.4.13 报告期末持有的因公允价值无法确定的股票

3.4.14 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他金融工具

3.4.15 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.16 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.17 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.18 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.19 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.20 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.21 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.22 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.23 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.24 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.25 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.26 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.27 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.28 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.29 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.30 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.31 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.32 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.33 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.34 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.35 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.36 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.37 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.38 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.39 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.40 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.41 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.42 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.43 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.44 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.45 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.46 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.47 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.48 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.49 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.50 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.51 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.52 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.53 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.54 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.55 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.56 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.57 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.58 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.59 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.60 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.61 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.62 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.63 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.64 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.65 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.66 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.67 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.68 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.69 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.70 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.71 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.72 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.73 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.74 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.75 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.76 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.77 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.78 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.79 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.80 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.81 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.82 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.83 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.84 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.85 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.86 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.87 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.88 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.89 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.90 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.91 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.92 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.93 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.94 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.95 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.96 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.97 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.98 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.99 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产

3.4.100 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他投资

3.4.101 报告期末持有的因公允价值无法确定的其他资产