

博时主题行业混合型证券投资基金(LOF)

2017 第一季度报告

2017年3月31日
基金管理人：博时基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一七年四月二十二日

基金管理人及董事承诺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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017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、勤勉尽责的原则履行受托管理职责，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。
本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

基金产品概况	
基金名称	博时主题行业混合
场内简称	博时主题
基金代码	060009
交易代码	960606
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2005年1月6日
报告期内净值增长	4,169.04%, 163.01%
投资目标	分享中国城市化、工业化及消费升级过程中经济与社会资本的高速成长,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采取价值驱动策略,在符合中国证监会规定的范围内,通过积极主动的资产配置,追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×20%+中证红利指数收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型基金,预期风险收益特征高于证券市场基金,本基金属于中高风险基金,属于证券投资基金中的较高风险品种。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

3.1.1 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期 (2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	207,411,072.94
2.本期公允价值变动收益	364,276,103.91
3.本期平均基金净值增长率	0.0079
4.本期基金净值增长率	7,534,112.80%
5.本期基金份额净值增长率	1.663

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。
上述基金净值增长率已扣除基金的各项费用,计入费用后投资者的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	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准差③	①-③	②-③
过去三个月	6.57%	0.08%	2.61%	0.47%	2.61%
过去六个月	6.57%	0.08%	2.61%	0.47%	0.15%

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



图1: 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

4.1 基金投资组合报告

4.1.1 基金投资组合报告

基金名称	期末资产净值	期末基金份额净值
博时主题行业混合	1,010,100,000.00	1.0101

注:本基金投资组合报告截至2017年3月31日。

4.2 基金管理人及基金托管人履行职责的情况

在报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规,本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、恪尽职守的原则,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期间,基金管理人及基金托管人严格遵守了相关法律法规的规定,没有损害基金份额持有人的利益。

4.3 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,未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内本基金由于在有色板块的配置,跑输基准。报告期内增加了水电和部分受益于消费升级的食品类股票的投资。报告期内本基金由于在有色板块的配置,跑输基准。报告期内增加了水电和部分受益于消费升级的食品类股票的投资。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年3月31日,本基金份额净值为1.6530元,累计份额净值为1.8800元,报告期内净值增长率为5.27%,同期业绩比较基准收益率为0.08%。

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.1.1 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,136,567,065.00	63.88
2	固定收益投资	510,134,615.00	6.48
3	其他资产	510,134,615.00	6.48
4	负债及所有者权益	-	-
5	其他资产	-	-
6	其他资产	-	-
7	其他资产	-	-
8	其他资产	-	-
9	其他资产	-	-
10	其他资产	-	-

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	69,280,000.00	0.69
B	制造业	2,182,200,248.52	20.97
C	建筑业	306,662,726.61	6.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	66,564,282.50	0.63
E	交通运输、仓储和邮政业	238,430,938.76	3.16
F	信息传输、软件和信息技术服务业	31,351,344.88	0.30
G	金融业	220,520,523.00	3.06
H	房地产业	1,248,372,880.52	16.57
I	其他行业	66,101,972.47	0.63
J	其他行业	10,762,161.39	0.10
K	其他行业	36,488,030.52	0.35
L	其他行业	-	-
M	其他行业	-	-
N	其他行业	-	-
O	其他行业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	其他行业	-	-
R	其他行业	-	-
S	其他行业	-	-
T	其他行业	-	-
U	其他行业	-	-
V	其他行业	-	-
W	其他行业	-	-
X	其他行业	-	-
Y	其他行业	-	-
Z	其他行业	-	-

5.3 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

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(%)
1	002210	东方时尚	41,000,000	654,790,000.00	6.69
2	001010	中国平安	11,969,961	441,118,186.51	4.61
3	000061	格力电器	14,000,000	443,300,000.00	4.61
4	000069	三花集团	36,094,688	343,781,316.40	3.61
5	000008	神州高铁	8,000,000	287,360,000.00	3.02
6	000029	招商局港口	19,000,000	286,790,400.00	3.02
7	000513	神州高铁	4,200,693	236,190,069.69	2.47
8	600000	中信证券	12,000,000	163,320,000.00	1.71
9	600000	长江电力	11,990,861	169,238,022.77	1.77
10	000088	招商局港口	3,799,942	139,039,477.78	1.46

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170204	17国债04	2,000,000	289,010,000.00	3.07
2	160211	16国债11	2,000,000	289,010,000.00	3.07
3	17110629	17上证国债29	1,000,000	160,000,000.00	1.71
4	131031	光大转债	210,340	21,034,000.00	0.22
5	128213	招商转债	1,750	181,015.00	0.00

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170204	17国债04	2,000,000	289,010,000.00	3.07
2	160211	16国债11	2,000,000	289,010,000.00	3.07
3	17110629	17上证国债29	1,000,000	160,000,000.00	1.71
4	131031	光大转债	210,340	21,034,000.00	0.22
5	128213	招商转债	1,750	181,015.00	0.00

5.6 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

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
2	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
3	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
4	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
5	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	贵金属名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
2	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
3	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
4	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
5	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

序号	股指期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
2	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
3	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
4	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
5	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名期权投资明细

序号	期权名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
2	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
3	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
4	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
5	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生品投资明细

序号	衍生品名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
2	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
3	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
4	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
5	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

序号	其他资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
2	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
3	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
4	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
5	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

序号	其他资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
2	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
3	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
4	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
5	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

序号	其他资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
2	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
3	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
4	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
5	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

序号	其他资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
2	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
3	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
4	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
5	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

序号	其他资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
2	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
3	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
4	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
5	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

序号	其他资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
2	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
3	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
4	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
5	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

序号	其他资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
2	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
3	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
4	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
5	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

序号	其他资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
2	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
3	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
4	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
5	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

序号	其他资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
2	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
3	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
4	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
5	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

序号	其他资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
2	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
3	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
4	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
5	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

序号	其他资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
2	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
3	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
4	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
5	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

序号	其他资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
2	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
3	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
4	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10
5	博时主题行业混合	1,010,100,000.00	10.10

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

序号	其他资产名称
----	--------