

## 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:中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一七年三月二十四日十二时  
§ 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、完整性和及时性负责。

基金合同由基金管理人和基金托管人根据不同的法律法规就本基金的特定事项订立，报告期内已对本基金中的财务指标、净值表现和投资组合报告等信息进行复核。

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。

本报吿书自2017年1月1日起至3月31日止。

## 1.2 基金产品概况

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	华东医药	41,000,000	654,770,000.00	8.60
2	601319	中国平安	11,000,000	444,116,106.51	6.00
3	000004	格力电器	14,000,000	445,000,000.00	6.00
4	600409	三一重工	35,994,508	305,488,216.40	4.56
5	600008	招商银行	35,000,000	267,050,000.00	3.02
6	000940	许继电气	15,000,000	205,050,494.52	3.02
7	000613	美的集团	4,200,003	236,199,306.69	3.14
8	600032	中国银行	12,000,000	193,320,000.00	2.57
9	600900	长信科技	11,999,853	190,238,022.77	2.11
10	600498	鞍钢股份	3,700,942	139,399,077.00	1.85

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	388,950,000.00	5.00
4	企业债	388,950,000.00	5.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交债)	21,294,615.00	0.28
8	同业存单	88,800,000.00	1.21
9	其他	-	-
10	合计	619,134,615.00	8.69

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贵金属投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	107000	17国债10(附息)	3,000,000	259,010,000.00	3.97
2	1600211	1600211(附息)	1,000,000	94,940,000.00	1.33
3	11711913	17国债3(F02029)	1,000,000	98,800,000.00	1.31
4	1513011	光大转债	210,340	21,034,000.00	0.28
5	1200131	鸿利转债	1,760	101,615.00	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贵金属投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	107000	17国债10(附息)	3,000,000	259,010,000.00	3.97
2	1600211	1600211(附息)	1,000,000	94,940,000.00	1.33
3	11711913	17国债3(F02029)	1,000,000	98,800,000.00	1.31
4	1513011	光大转债	210,340	21,034,000.00	0.28
5	1200131	鸿利转债	1,760	101,615.00	0.00

5.7 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

(2017年1月1日-2017年3月31日)

1本期初次收入 297,411,972.34

3期初可供分配利润 364,276,193.81

4加权平均基金份额本期利润 0.0076

5期末基金资产净值 7,534,112,836.02

6本期末可供分配利润 1,663.76

7.3.1 主要财务指标和基金净值表现

注:本报告期无应收利息收入、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,本期利润为本期实现的初次收入减去本期费用后的余额。

上述基金业指标均扣除持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资收益水平将低于所列示数字。

3.2 基金的净值表现

3.2.1 本基金的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 净值增长率为% 净值增长率标准差为% 业绩比较基准收益率为% 业绩比较基准收益率标准差为%

过去三个月 -0.57% -0.38% -0.43% -0.32%

3.2.2 本基金当期生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金当期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

3.3 主要财务指标和基金净值表现

注:本报告期无应收利息收入、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,本期利润为本期实现的初次收入减去本期费用后的余额。

上述基金业指标均扣除持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资收益水平将低于所列示数字。

3.2.3 基金的净值表现

3.2.3.1 本基金的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 净值增长率为% 净值增长率标准差为% 业绩比较基准收益率为% 业绩比较基准收益率标准差为%

过去三个月 -0.57% -0.38% -0.43% -0.32%

3.2.3.2 本基金当期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

注:本基金当期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

3.3.1 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.2 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.3 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.4 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.5 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.6 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.7 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.8 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.9 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.10 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.11 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.12 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.13 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.14 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.15 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.16 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.17 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.18 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.19 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.20 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.21 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.22 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.23 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.24 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.25 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.26 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.27 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.28 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.29 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.30 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.31 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.32 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.33 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.34 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.35 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.36 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.37 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.38 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.39 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.40 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.41 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.42 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.43 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.44 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.45 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.46 基金管理人运用货币资金投资情况

3.3.47 基金管理人运用货币资金投资情况