

博时战略新兴产业混合型证券投资基金

2018年半年度报告摘要

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:二〇一八年八月二十九日

§ 1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构均不存在虚假记载、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2018年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金简介

2.1.1 基金基本情况

基金名称	博时战略新兴产业混合
基金代码	004077
交易代码	004077
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月9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
境外基金总部总部	96-228-2348799
基金合同存续期	不定期

2.1.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过挖掘新兴产业政策支持下下的投资机会,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将采取自下而上和自上而下相结合的投资策略。本基金投资组合中股票资产投资比例不低于基金资产的70%-85%。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率*70%+上证国债指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于风险水平中等的基金。

2.1.3 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	博时基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	孙勇	胡明
联系电话	0755-83160999	010-66106798
电子邮箱	news@boson.com.cn	custo@icbc.com.cn
客户服务热线	961056688	96188
传真	0755-83161440	010-66106798

2.1.4 信息披露方式

信息披露半年度报告正文的互联网网址	http://www.boson.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	报告期间(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期累计实现收益	2,521,291.50
本期利润	-3,286,264.96
加权平均基金份额本期利润	-0.0594
本基金基金份额净值增长率	-0.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末基金份额总额	49,326,934.97
期末基金资产净值	49,136,779.79
期末基金份额净值	1.049

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。

期末可供分配利润是指期末基金资产净值中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰孰较小。

上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

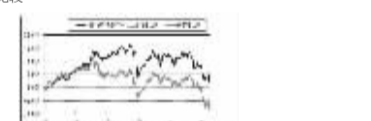
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率	绝对收益比较基准收益率	跟踪误差比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	-3.68%	1.31%	-7.31%	1.26%	3.53%	0.05%
过去六个月	-6.50%	1.07%	-6.55%	0.95%	2.93%	0.09%
过去一年	-6.93%	1.17%	-8.00%	1.03%	2.83%	0.14%
过去三年	4.91%	0.97%	-5.83%	0.91%	10.70%	0.00%

注:本基金的业绩比较基准为:中证新兴产业指数*75%+上证国债指数*25%。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基金净值日回报75%、25%的比例采取再平衡,再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的基金合同于2017年08月09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二部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。本基金建仓期结束前各项资产配置比例符合基金合同约定。

4.1 基金管理人及基金托管情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一,“为国民创造财富”是博时的使命。

截至2018年06月30日,博时基金公司共管理186只开放式基金,并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金,以及多个企业年金账户,管理资产总规模达9461亿元人民币,其中非货币公募基金规模逾1947亿元人民币,累计分红逾72亿元人民币,是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一,养老金业务规模在业内名列前茅。

1. 基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计,截至2018年二季度:

权益基金方面,标准指数股票型基金中,博时中证智能大数据100指数(A类)、博时裕富沪深300指数(A类)等今年以来净值增长同类排名居前1/4;股票分级基金中,博时中证银行分级指数(B级)等今年以来净值增长同类基金中排名居前1/3;混合偏股型基金中,博时创业成长混合(C类)今年以来净值增长同类基金排名居前1/10,博时行业轮动混合(C类)今年以来净值增长同类基金排名居前1/3;混合灵活配置型基金中,博时裕益灵活配置混合基金今年以来净值增长率为3.14%,在146只同类基金排名第6,博时汇智回报灵活配置混合基金今年以来净值增长率为1.36%,同类基金排名位居前1/10,博时新价值灵活配置混合(A类)、博时新策略灵活配置混合(A类)、博时起航点灵活配置混合(A类)、博时新起点灵活配置混合(C类)今年以来净值增长率为2.12%、1.93%、1.65%、1.60%,同类基金排名均位居前1/8,博时新价值灵活配置混合(C类)今年以来净值增长率为2.07%,同类基金中排名位居前1/6。

黄金基金方面,博时黄金ETF联接(A类)、博时黄金ETF联接(C类)今年以来净值增长同类排名第一。

固收方面,长期标准债券型基金中,博时天颐债券(A类)、博时安宏回报债券(A/B类)、博时信用债券(A/B类)今年以来净值增长率为5.11%、4.56%、4.54%,同类219只基金中分别排名第3、第9、第9位,博时天颐债券(C类)、博时信用债券(R类)、博时信用债券(C类)、博时宏观回报债券(C类)今年以来以来净值增长率为4.88%、4.56%、4.34%、4.23%,同类153只基金中分别排名第2、第4、第7、第8位,博时富华纯债债券、博时新纯债债券、博时富瑞纯债债券、博时裕利纯债债券、博时富发纯债债券、博时聚瑞纯债债券等今年以来净值增长率为4.43%、4.10%、3.98%、3.93%、3.89%、3.85%,同类排名均前1/10;货币基金类,博时兴荣货币、博时合利货币(A类)今年以来净值增长率为2.21%、2.18%,在315只同类基金排名中位列第15位与第24位。

ODD基金方面,博时标普500ETF(ODD)、博时标普500ETF联接(ODD)(A类),今年以来净值增长同类排名分别位于前1/5、1/4。

2. 其他大事件

2018年6月8日,由《中国证券报》主办的中国基金业二十周年高峰论坛暨第十五届“中国基金业金牛”颁奖典礼在苏州隆重举行,经过激烈且公平的票选,博时基金获得“2017年度最受信赖金牛基金公司”荣誉称号。

2018年5月24日,由《中国证券报》、《证券时报》主办的“第五届中国基金业英华奖、中国基金业20年最佳基金经理评选颁奖典礼暨高峰论坛”在深圳隆重举行。从业经历逾23年的博时基金副基金经理高级投资经理董良玖荣获“中国基金业20年最佳基金经理”殊荣,此荣誉于全行业仅有20人获评;博时基金固收老将陈凯歌凭借长期稳健的投资业绩荣获“三年期纯债投资最佳基金经理”称号,值得一提的是,这也是陈凯歌继2016年之后连续两年蝉联该项殊荣,足见市场对其管理能力的认可。

2018年5月23日,由新浪财经和经济学家主办的“致敬公募20年”颁奖典礼在北京举行,公募基金五家之一的博时基金凭借长期优良的研究业绩、雄厚的综合实力和对最佳投资理念的一贯倡导共获“最佳资产管理公司”、“最受投资者欢迎基金公司”、“行业特别贡献奖”和“区域影响力奖”三等奖。博时旗下产品博时双月薪定期支付债券基金(000277)获得“最佳价值理念基金产品-债券类型”,博时亚洲货币基金收益债券(FDI1)(人民币060030、美元现汇:060020、美元现钞:060023)获得“最具投资价值基金产品-ODD”。

2018年5月17日,被评为“证券期货行业科学技术领域最高荣誉”的第六届中国证券期货行业奖颁奖典礼在北京揭晓,博时基金从上百个竞争对手中脱颖而出,一举夺得二等奖(DivOps统一研发平台)、三等奖(证券投资基金行业核心业务软件系统统一测试)以及优秀奖(新一代基金理财综合服务平台)三大项,成为获得奖项最多的金融机构之一。

2018年5月10日,由《上海证券报》主办的“2018中国基金业峰会暨第十五届

基金业颁奖典礼”在上海举行。在此次颁奖典礼上,博时基金荣获“基金TOP基金公司”这一最具价值的公司大奖;博时基金权益总部董事总经理兼股票投资部总经理李权胜获评“基金最佳投资回报基金经理奖”,在第五届中国基金业评选中,旗下价值投资典范产品博时主题行业(160605)获得“三年期金牛基金分红奖”。

2018年3月26日,第十五届中国基金业金牛奖评选活动拉开帷幕。公募“老五家”之一的博时基金凭借长期出色的投资业绩、锐意进取的创新态度和对价值投资的坚守一举夺得全场份量最重的“中国基金业20年卓越贡献公司”大奖。同时,旗下旗舰产品博时主题行业混合(L0F)(160605)荣获“2017年度开放式基金最佳金牛基金”奖;博时信用债纯债债券(060027)荣获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2018年3月22日,由中国基金报、香山财富论坛主办的“第五届中国机构投资者峰会暨中国基金业英华奖公募基金20周年特别评选、中国基金业明星基金颁奖典礼”在北京举办,本次评选中,博时基金一举斩获本届“十大公募基金颁奖典礼”中最具分量的两项公司级大奖——公募基金20年“十大最佳基金管理人”奖和“最佳固定收益基金管理人”奖,同时,旗下明星基金博时主题行业、博时信用债券分别荣获“最佳回报混合型基金”奖和“最佳回报债券型基金(二级债)”奖,双双收入囊中,博时聚瑞纯债债券则获得“2017年度普通债券型明星基金”奖。

2018年2月2日,由金融界主办,第二届智能金融国际论坛暨“暨第六届金融界”颁“领航中国”年度盛典在南京举办,此次论坛以“安全与创新”为主题,邀请业内专家学者就现阶段行业发展的热点问题深入探讨。博时基金凭借优异的业绩与卓越的品牌影响力斩获“五年期投资回报基金管理公司奖”和“杰出品牌影响力奖”两项大奖。

2018年1月11日,由中国基金报主办的“中国基金业创新发展高峰论坛暨中国基金业20年最佳创新产品颁奖典礼”在上海举办,博时基金一举斩获“十大产品创新基金公司奖”,旗下产品博时主题行业混合基金(160605)和博时黄金ETF分别获得“最佳主动权益创新产品奖”和“最佳互联网创新产品奖”,成为当天最大赢家之一。

2018年1月9日,由信息时报主办的“第六届信息时报金狮奖——2017年度金融行业风云榜颁奖典礼”在广州隆重举行。博时基金凭借优秀的基金业绩和广泛的社影响力荣获“年度最具影响力基金公司大奖”。

4.1.2 基金投资(或基金投资组合)及基金经理助理的简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任职日期	证券从业年限	说明
曹阳	基金经理	2017-08-09	-	11

注:上述任职日期、离任日期指本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义泛指在行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对外报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》及其他各项法律法规、基金合同和其他相关法律法规的规定,并未有损害基金份额持有人利益、损害基金份额持有人利益的行为发生。

4.3 基金管理人对外报告期内基金资产净值变动情况的说明

截至2018年06月30日,本基金基金份额净值1.049元,累计净值1.049元。报告期内,本基金基金份额净值增长率为-6.92%,同期业绩比较基准为-9.80%。

4.4 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和业绩表现的说明

本基金产品持续从战略新兴产业方向挖掘优质投资标的,主要采取行业比较、精选个股的投资策略,重点关注环保、新能源、自动化、高端装备、信息化、新材料、消费升级等产业中的优质企业的投资机会。报告期内,基金结构维持均衡配置风格,降低固收,消费、TMT等板块配置,调换部分医药行业个股,增加新能源汽车行业的中游及零部件优质企业配置。

4.4.2 报告期内本基金的投资表现

截至2018年06月30日,本基金基金份额净值1.049元,累计净值1.049元。报告期内,本基金基金份额净值增长率为-6.92%,同期业绩比较基准为-9.80%。

4.4.3 基金管理人对外报告期内基金资产净值变动情况的说明

4.4.4 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.5 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.6 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.7 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.8 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.9 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.10 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.11 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.12 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.13 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.14 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.15 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.16 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.17 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.18 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.19 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.20 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.21 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.22 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.23 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.24 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.25 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.26 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.27 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.28 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.29 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.30 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.31 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.32 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.33 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.34 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.35 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.36 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.37 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.38 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.39 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.40 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.41 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.42 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.43 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.44 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.45 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.46 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.47 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.48 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.49 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.50 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.51 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.52 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.53 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.54 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.55 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.56 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.57 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.58 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.59 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.60 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.61 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.62 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.63 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

4.4.64 基金管理人对外报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.049元,基金份额总额49,326,934.97份。

6.2 利润表

会计主体:博时战略新兴产业混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	-2,184,069.20
1.利息收入	27,334.87
其中:存款利息收入	25,023.46
债券利息收入	56,343.31
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	149,306.10
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	3,210,460.60
其中:股票投资收益	2,509,223.56
债券投资收益	6,456.20
资产支持证券投资损益	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-5,819,889.44
3.其他综合收益(损失以“-”号填列)	-
4.其他收入(损失以“-”号填列)	189,007.83
减:费用	1,113,609.61
1.管理人报酬	466,006.61
2.托管费	77,679.27
3.销售服务费	-
4.交易费用	391,623.47
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	-
7.其他	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-3,208,264.96
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-3,208,264.96

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时战略新兴产业混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	2018年1月1日	本期	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	92,136,773.77	11,728,530.00	103,865,303.77
二、本期投资损益	-	-3,208,264.96	-3,208,264.96
三、本期基金份额交易产生的净值变动额	-45,307,038.60	-6,122,321.10	-51,430,259.60
其中:申购(赎回)款项净额	8,688,585.46	896,113.89	9,584,699.34
2.赎回款项	-53,996,522.06	-7,018,434.99	-61,014,957.04
四、本期基金份额持有人申购/赎回款产生的利息和费用	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	46,829,434.97	2,307,943.92	49,136,779.79