

# 博时主题行业混合型证券投资基金 (LOF)

## 2016 年第 3 季度报告

### 2016 年 9 月 30 日

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：二〇一六年十月二十四日

## § 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10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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 博时主题行业混合(LOF)  |
| 场内简称       | 博时主题   |
| 基金主代码      | 160505   |
| 交易代码       | 160505   |
| 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  |
| 报告期末基金份额总额 | 3,444,803,391.56份  |
| 投资目标       | 分享中国城市化、工业化及消费升级进程中经济与资本市场的高速成长，谋求基金资产的长期稳定增长。                 |
| 投资策略       | 本基金采取价值策略指导下的行业增强型主动投资策略                                       |
| 业绩比较基准     | 80%×富时中国A600指数+20%×富时中国国债指数                                    |
| 风险收益特征     | 本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险/收益品种。 |
| 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

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期                    |  |
|-----------------|------------------------|--|
|                 | (2016年7月1日-2016年9月30日) |  |
| 1. 本期已实现收益      | 280,593,977.11         |  |
| 2. 本期利润         | 508,902,284.46         |  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1490                 |  |
| 4. 期末基金资产净值     | 6,867,522,398.56       |  |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.994                  |  |

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。

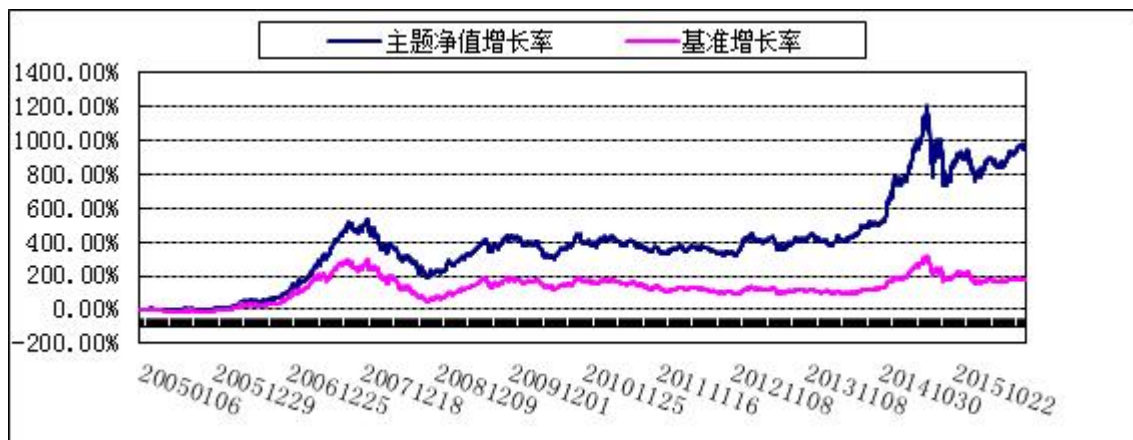
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

### 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

| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④   |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 8.13%  | 0.70%     | 2.32%      | 0.64%         | 5.81% | 0.06% |

#### 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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务          | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|-------------|-------------|------|--------|--|
|    |             | 任职日期        | 离任日期 |        |  |
| 王俊 | 研究部总经理/基金经理 | 2015-01-22  | -    | 8.5    | 2008年从上海交通大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、金融地产与公用事业组组长、研究部副总经理、博时国企改革股票基金、博时丝路主题股票基金的基金经理。现 |

|  |  |  |  |  |                               |
|--|--|--|--|--|-------------------------------|
|  |  |  |  |  | 任研究部总经理兼博时主题行业混合(LOF)基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|-------------------------------|

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《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》及其各项实施细则、本基金基金合同和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规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 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。

##### 4.3.2 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。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内本基金在上涨期间凭借在低估值/高股息股票和在PPP主题龙头股票上的配置，跑赢基准。报告期内增加了PPP主题龙头股票的配置取得了较好的绝对收益和相对收益。期末增加了部分化工股票的配置。报告期内降低了供给侧改革相关股票的配置并降低了仓位。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年9月30日，本基金份额净值为1.994元，累计份额净值为5.098元，报告期内净值增长率为8.13%，同期业绩基准涨幅为2.32%。

#### 4.6 报告期内基金持有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) | 占基金总资产的比 |
|----|----|-------|----------|
|----|----|-------|----------|

|   |                   |                  | 例(%)   |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 1 | 权益投资              | 4,689,558,873.43 | 67.33  |
|   | 其中：股票             | 4,689,558,873.43 | 67.33  |
| 2 | 固定收益投资            | 300,375,127.50   | 4.31   |
|   | 其中：债券             | 300,375,127.50   | 4.31   |
|   | 资产支持证券            | -                | -      |
| 3 | 贵金属投资             | -                | -      |
| 4 | 金融衍生品投资           | -                | -      |
| 5 | 买入返售金融资产          | 1,485,001,047.50 | 21.32  |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -      |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计      | 102,927,718.19   | 1.48   |
| 7 | 其他各项资产            | 387,261,235.80   | 5.56   |
| 8 | 合计                | 6,965,124,002.42 | 100.00 |

## 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境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值(元)          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 727,798,506.76   | 10.60        |
| B  | 采矿业              | 72,900,000.00    | 1.06         |
| C  | 制造业              | 1,848,692,407.80 | 26.92        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 137,753,188.65   | 2.01         |
| E  | 建筑业              | 654,445,121.00   | 9.53         |
| F  | 批发和零售业           | 45,314,822.38    | 0.66         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -                | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 24,731,395.54    | 0.36         |
| J  | 金融业              | 1,098,089,398.44 | 15.99        |
| K  | 房地产业             | -                | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 24,519,854.94    | 0.36         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -                | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 15,551,248.32    | 0.23         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -            |
| P  | 教育               | -                | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -                | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 39,762,929.60    | 0.58         |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 4,689,558,873.43 | 68.29        |

### 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  | 002310 | 东方园林 | 38,000,000 | 593,560,000.00 | 8.64         |
| 2  | 000651 | 格力电器 | 24,233,380 | 538,465,703.60 | 7.84         |
| 3  | 300498 | 温氏股份 | 14,500,792 | 520,143,409.04 | 7.57         |

|    |        |      |            |                |      |
|----|--------|------|------------|----------------|------|
| 4  | 000333 | 美的集团 | 18,441,700 | 498,110,317.00 | 7.25 |
| 5  | 601318 | 中国平安 | 10,400,054 | 355,265,844.64 | 5.17 |
| 6  | 600036 | 招商银行 | 15,000,000 | 270,000,000.00 | 3.93 |
| 7  | 002714 | 牧原股份 | 8,500,004  | 207,655,097.72 | 3.02 |
| 8  | 002508 | 老板电器 | 4,050,914  | 167,181,220.78 | 2.43 |
| 9  | 600409 | 三友化工 | 15,994,762 | 140,753,905.60 | 2.05 |
| 10 | 002092 | 中泰化学 | 9,993,870  | 97,440,232.50  | 1.42 |

#### 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  | 国家债券      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 300,160,000.00 | 4.37         |
|    | 其中：政策性金融债 | 300,160,000.00 | 4.37         |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 215,127.50     | 0.00         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 300,375,127.50 | 4.37         |

#### 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债券投资明细

| 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  | 160209 | 16 国开 09      | 2,000,000 | 200,000,000.00 | 2.91         |
| 2  | 160211 | 16 国开 11(增 2) | 1,000,000 | 100,160,000.00 | 1.46         |
| 3  | 128013 | 洪涛转债          | 1,750     | 215,127.50     | 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

#### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或

在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)          |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 2,448,168.13   |
| 2  | 应收证券清算款 | 377,850,700.75 |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 4,053,579.53   |
| 5  | 应收申购款   | 2,908,787.39   |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 387,261,235.80 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 3,406,545,625.95 |
| 报告期基金总申购份额   | 194,356,800.43   |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 156,099,034.82   |
| 报告期基金拆分变动份额  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额 | 3,444,803,391.56 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。



## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

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。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至2016年9月30日，博时基金公司共管理138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，管理资产总规模约为5,359.54亿元人民币，其中公募基金规模约2,912.48亿元人民币，累计分红约738.04亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

### 1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，2016年三季度，博时旗下基金业绩依然领先。

截至9月30日，权益类方面，标准指数股票型基金中，博时中证淘金大数据100指数基金、博时中证银行指数分级，今年以来净值增长率在同类型316只基金中排名前10；偏股型基金里，博时行业轮动基金、博时主题行业混合基金，今年以来净值增长率在同类372只基金中排名前20；灵活配置型基金中，博时灵活配置混合A，今年以来净值增长率在同类排名前1/10；保本型基金中，博时招财一号大数据保本混合，今年以来净值增长率在同类排名前1/4；绝对收益目标基金中，博时新财富混合基金今年以来净值增长率为5.36%，在同类165只基金中排名前1/7。

黄金基金中，博时黄金ETF(D类)今年以来净值增长率为28.42%，在同类8只基金中排名第一。

固定收益方面，标准债券型基金中，博时双月薪定期支付债券、博时月月薪定期支付债券，今年以来净值增长率分别为6.91%、5.23%，在同类型61只基金中分别第二和第五，博时信用债纯债排名前1/9；普通债券型基金里，稳健回报债券(LOF)今年以来净值增长率在同类排名前1/4；货币市场基金里，博时外服货币，今年以来净值增长率在同类194只排名第五；封闭式标准债券基金中，博时安丰18个月定开债今年以来净值增长率在同类排名前1/4。

QDII基金方面，博时亚洲票息，今年以来至9月30日净值增长9.92%，在同类QDII债券基金11只中排名前1/2。

### 2、其他大事件



•2016年8月5日,由21世纪经济报道主办的“2016深港通论坛暨‘金帆奖’系列颁奖礼上,博时一举斩获2016年综合实力十强基金公司奖、2016年互联网突出表现奖、2016年ABS最具实力管理人奖(博时资本)三项大奖。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证监会批准博时主题行业混合型证券投资基金(LOF)设立的文件
- 9.1.2 《博时主题行业混合型证券投资基金(LOF)基金合同》
- 9.1.3 《博时主题行业混合型证券投资基金(LOF)托管协议》
- 9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 9.1.5 博时主题行业混合型证券投资基金(LOF)各年度审计报告正本
- 9.1.6 报告期内博时主题行业混合型证券投资基金(LOF)在指定报刊上各项公告的原稿

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通:95105568(免长途话费)

博时基金管理有限公司  
二〇一六年十月二十四日