

博时新机遇混合型证券投资基金

2015 年第 3 季度报告

2015 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：二〇一五年十月二十六日

§ 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 2015 年 10 月 23 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。

自 2015 年 9 月 11 日起，《博时理财 30 天债券型证券投资基金基金合同》失效且《博时新机遇混合型证券投资基金基金合同》同时生效，博时理财 30 天债券型证券投资基金正式变更为博时新机遇混合型证券投资基金。原博时理财 30 天债券型证券投资基金本报告期自 2015 年 7 月 1 日至 2015 年 9 月 10 日止，博时新机遇混合型证券投资基金本报告期自 2015 年 9 月 11 日至 2015 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 博时新机遇混合型证券投资基金

基金简称:	博时新机遇混合
基金主代码	050029
交易代码:	050029
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2015 年 9 月 11 日
报告期末基金份额总额:	9,708,852.09 份
投资目标:	本基金通过对多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期持续稳定的投资回报。
投资策略:	本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析互相补充的方法，在股票、债券和现金等资产类之间进行相对稳定的适度配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。

业绩比较基准:	一年期银行定期存款利率（税后）+3%
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，属于中等收益/风险特征的基金。
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

2.2 原博时理财 30 天债券型证券投资基金

基金简称	博时理财 30 天债券	
基金主代码	050029	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 1 月 28 日	
报告期末基金份额总额	10,069,892.51 份	
投资目标	本基金在保持资产相对流动性的基础上，努力追求绝对收益，争取为基金份额持有人谋求资产的增值。	
投资策略	本基金通过对宏观经济运行和货币财政政策的分析，预判未来市场利率变化趋势，采用积极管理型的投资策略，将投资组合的平均剩余期限控制在 150 天以内。采用利率策略、信用策略、个券选择等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，争取提高基金收益。	
业绩比较基准	七天通知存款税后利率（税后）	
风险收益特征	本基金为短期理财债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，预期收益和预期风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	博时理财 30 天债券 A	博时理财 30 天债券 B
下属两级基金的交易代码	050029	050129
报告期末下属两级基金的份 额总额	10,069,892.51 份	-份

§ 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

项目	2015 年第 3 季度报告		
	转型后（2015 年 9 月 11 日-2015 年 9 月 30 日）	转型前（2015 年 7 月 1 日-2015 年 9 月 10 日）	
		博时理财 30 天债券 A	博时理财 30 天债券 B
1. 本期已实现收益	-23,472.94	8,600.77	4,533.41

2. 本期利润	-23,316.94	8,600.77	4,533.41
3. 加权平均基金份额 本期利润	-0.0024	-	-
4. 期末基金资产净值	9,685,931.12	10,069,892.51	-
5. 期末基金份额净值	0.998	-	-

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。

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。

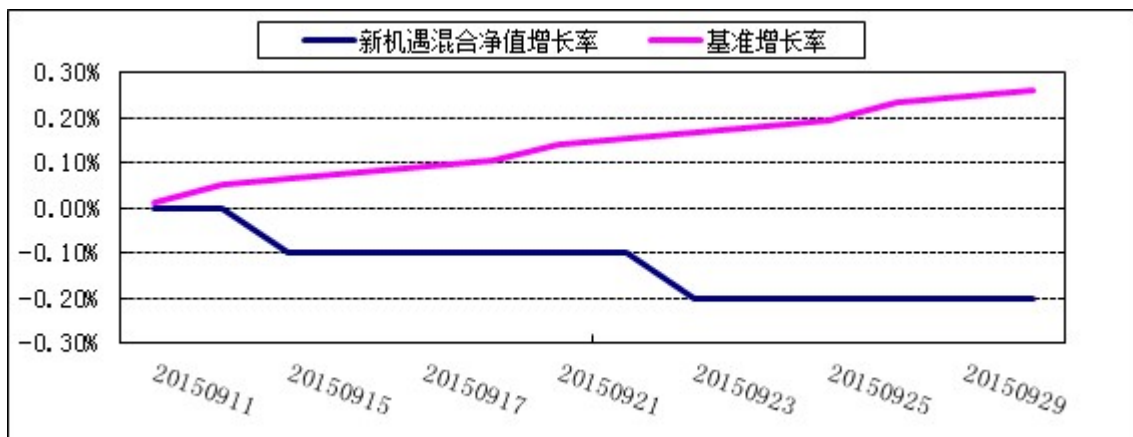
3.2 基金净值表现

3.2.1 博时新机遇混合型证券投资基金

3.2.1.1 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	-0.20%	0.04%	0.26%	0.01%	-0.46%	0.03%

3.2.1.2 自基金转型以来基金累计份额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：本基金合同于 2015 年 9 月 11 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第九条（二）投资范围、（五）投资限制的约定。本报告期末本基金的建仓期尚未结束。

3.2.2 原博时理财 30 天债券型证券投资基金

3.2.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、博时理财 30 天债券 A：

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	-0.20%	0.04%	0.26%	0.01%	-0.46%	0.03%

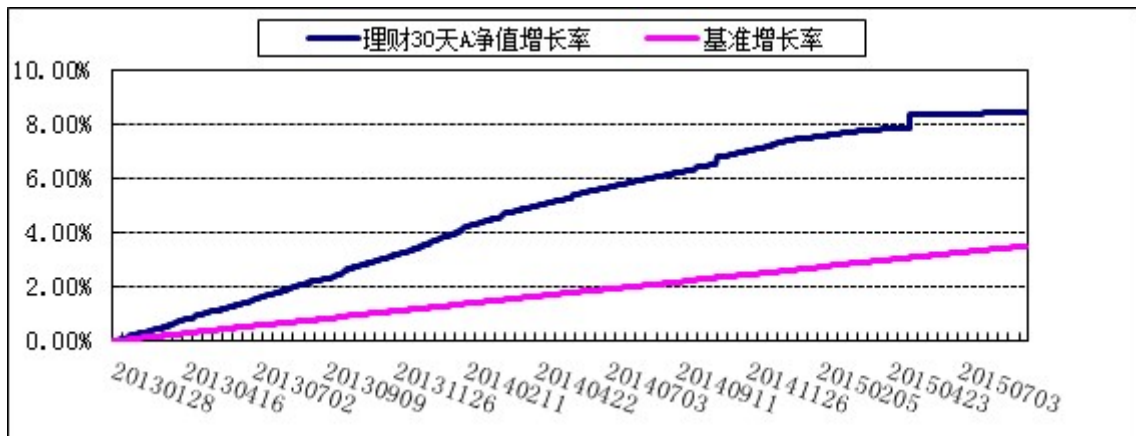
过去三个月	0.0630%	0.0002%	0.2663%	0.0000%	-0.2033%	0.0002%
-------	---------	---------	---------	---------	----------	---------

2、博时理财 30 天债券 B:

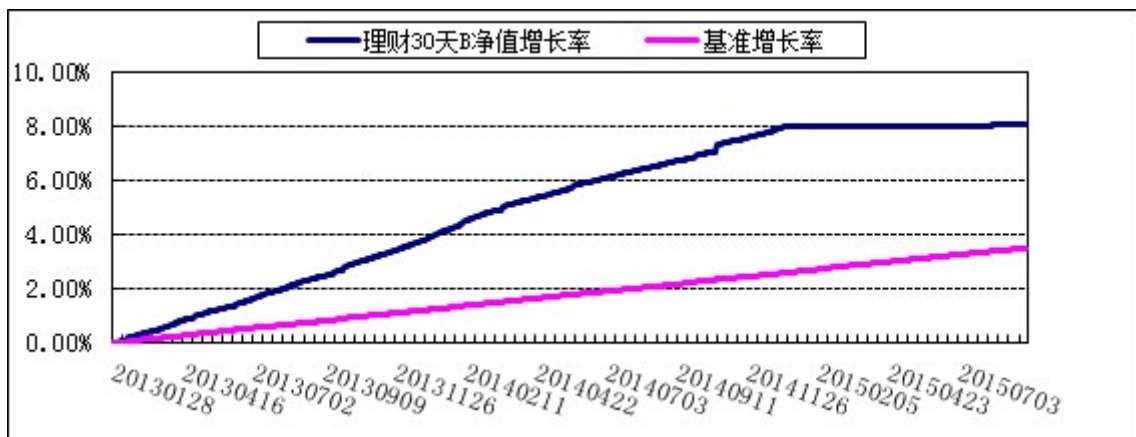
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.0415%	0.0008%	0.2663%	0.0000%	-0.2248%	0.0008%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1、博时理财 30 天债券 A



2、博时理财 30 天债券 B



注：本基金合同于 2013 年 1 月 28 日生效。按照基金合同规定，本基金建仓期为 30 天。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定。本基金于 2015 年 9 月 11 日正式转型为博时新机遇混合型证券投资基金。

§ 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		
杨永光	固定收益总部公募基金公司投资副总监/基金经理	2015-09-11	-	13.5	1993 年至 1997 年先后在桂林电器科学研究所、深圳迈瑞生物医疗电子股份公司工作。1997 年起在国海证券历任债券研究员、债券投资经理助理、高级投资经理、投资主办人。2011 年加入博时基金管理有限公司，曾任博时稳定价值债券基金的基金经理。现任固定收益总部公募基金公司投资副总监兼博时天颐债券基金、上证企债 30ETF 基金、博时优势收益信用债债券基金、博时招财一号保本基金、博时新机遇混合基金的基金经理

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年三季度，国内地产投资未见起色，经济增长弱于预期，企业经营效益加速恶化。券商两融市场及场外配资的清理，加速了权益市场的调整，转债市场也遭受重

创。同时，IPO 的暂停使得大量的打新资金涌入债券市场，债券市场出现了较大的上涨行情，信用债上涨幅度相对较大，与利率债的利差进一步缩小。9 月份本基金由理财型基金转型为混合基金，目前正处于建仓期，权益与债券仓位少，因此 9 月末净值无大的变化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 0.998 元，累计份额净值为 0.998 元。报告期内，本基金由博时理财 30 天债券型证券投资基金转型为博时新机遇混合型证券投资基金。转型前，自 2015 年 7 月 1 日至 2015 年 9 月 10 日，博时理财 30 天债券型证券投资基金 A 类份额净值增长率为 0.06%，B 类份额净值增长率为 0.04%，同期业绩比较基准收益率为 0.27%；转型后，自 2015 年 9 月 11 日至报告期末，博时新机遇混合型证券投资基金份额净值增长率为-0.20%，同期业绩基准增长率为 0.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下个季度，权益市场在经过深度回调之后已有一定的投资价值，优质个股的机遇大于风险。但考虑到基金尚处于成立初期，盈利小，还没积累足够的安全垫，因此四季度将会严格控制对权益的投资比例；同时，逐步增加对短久期信用债的投资比例，只有在债券市场出现明显调整之后再择机拉长债券组合久期，力争实现基金净值的平稳增长。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金已于 2015 年 9 月 11 日转型为博时新机遇混合型证券投资基金。

§ 5 投资组合报告

5.1 博时新机遇混合型证券投资基金投资组合报告

（报告期：2015 年 9 月 11 日-2015 年 9 月 30 日）

5.1.1 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	208,680.00	1.60
	其中：股票	208,680.00	1.60
2	固定收益投资	2,133,400.00	16.37
	其中：债券	2,133,400.00	16.37

	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	3,000,000.00	23.02
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	7,666,954.79	58.84
6	其他各项资产	20,884.87	0.16
7	合计	13,029,919.66	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	119,100.00	1.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	89,580.00	0.92
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	208,680.00	2.15

5.1.3 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	600305	恒顺醋业	6,000	119,100.00	1.23
2	601318	中国平安	3,000	89,580.00	0.92

5.1.4 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	2,133,400.00	22.03
2	央行票据	-	-

3	金融债券		-	-
	其中：政策性金融债		-	-
4	企业债券		-	-
5	企业短期融资券		-	-
6	中期票据		-	-
7	可转债		-	-
8	其他		-	-
9	合计		2,133,400.00	22.03

5.1.5 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	010107	21 国债(7)	20,000	2,133,400.00	22.03

5.1.6 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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.1.7 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。

5.1.8 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。

5.1.9 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。

5.1.10 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。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 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。

5.1.11.2 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。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	15,806.39
5	应收申购款	5,078.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,884.87

5.1.11.4 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。

5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.1.11.6 其他需说明的重要事项

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。

5.2 原博时理财 30 天债券型证券投资基金

(报告期：2015 年 7 月 1 日-2015 年 9 月 10 日)

5.2.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	10,368,059.47	99.92
6	其他各项资产	8,692.63	0.08
7	合计	10,376,752.10	100.00

5.2.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	-	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-

其中：买断式回购融资	-	-
------------	---	---

注：报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产余额比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 40% 的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 40%。

5.2.3 基金投资组合平均剩余期限

5.2.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	0
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

报告期内投资组合平均剩余期限超过 150 天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限没有超过 150 天的情况。

5.2.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	102.96	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—180天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天（含）—397天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	102.96	-

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.2.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.2.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0 次
报告期内偏离度的最高值	0.02%
报告期内偏离度的最低值	-0.06%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.01%

注：上表中“偏离情况”根据报告期内各工作日数据计算。

5.2.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.2.8 投资组合报告附注

5.2.8.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持 1.00 元。

5.2.8.2 本报告期内，本基金未持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券。

5.2.8.3 报告期内本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。

5.2.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	8,692.63
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	8,692.63

5.2.8.5 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

6.1 博时新机遇混合型证券投资基金投资组合报告

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	10,069,892.51
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	71,507.96
基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	432,548.38
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	9,708,852.09

注：本基金合同于 2015 年 9 月 11 日生效。

6.2 原博时理财 30 天债券型证券投资基金

单位：份

项目	博时理财30天债券A	博时理财30天债券B
本报告期期初基金份额总额	16,187,353.22	-
本报告期基金总申购份额	1,055,718.11	25,006,533.41
本报告期基金总赎回份额	7,173,178.82	25,006,533.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	10,069,892.51	-

注：本基金于 2015 年 9 月 11 日正式转型为博时新机遇混合型证券投资基金。

§ 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 2015 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理七十一只开放式基金，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。博时基金资产管理净值总规模逾 3010.43 亿元人民币，其中公募基金资产规模逾 1,427.53 亿元人民币，累计分红超过 670.72 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，指数股票型基金中，截至 9 月 30 日，博时裕富沪深 300 基金及博时深证基本面 200ETF 今年以来净值增长率在 172 只标准型股票基金中分别排名前 1/2；混合基金-偏股型基金中，博时创业成长混合基金、博时卓越品牌混合（LOF）、博时医疗保健行业混合基金今年以来净值增长率在 360 只混合偏股基金中排名前 1/2；混合基金-灵活配置型基金中，博时灵活配置混合基金今年以来收益率在 103 只同类基金中排名前 1/2。

固定收益方面，博时安丰 18 个月定期开放债券 LOF 今年以来在 15 只同类封闭普通股票型基金中排名第一。在长期标准债券基金 A 类中，博时双月薪定期支付债券今年以来收益率在同类 68 只排名前 1/10，博时岁岁增利一年定期开放债券、博时月月薪定期支付债券排名前 1/3，博时信用债纯债 A、博时安心收益定期开放债券 A 以及博时优势收益信用债债券基金排名前 1/2；在长期标准债券基金 B/C 类中，博时安心收益定期开放债券 C 类今年以来收益率在同类 47 只中排名前 1/3；普通债券型基金中，博时稳定价值债券 A 类和 B 类在同类 88 只一级 A 类和 51 只一级 B 类中，今年以来收益率都排名前 1/5；可转债基金中，博时转债增强 A 今年以来收益率在同类 15 只排名前 1/2；指数债券型中，博时上证企债 30ETF 在同类 18 只中排名前 1/3；货币市场基金里，博时现金宝货币 A 类在同类 150 只中排名前 1/2。

2、其他大事件

2015 年 8 月 3 日，博时基金经理过钧和张溪冈，荣获证券时报颁发的英华奖；同时，过钧获得证券时报评选的三年期和五年期固定收益类-最佳基金经理，张溪冈获得证券时报评选的三年期海外投资-最佳基金经理。

§ 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新机遇混合型证券投资基金设立的文件
- 9.1.2 《博时新机遇混合型证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时新机遇混合型证券投资基金托管协议》
- 9.1.4 《博时理财 30 天债券型证券投资基金基金合同》
- 9.1.5 《博时理财 30 天债券型证券投资基金托管协议》
- 9.1.6 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 9.1.7 报告期内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

2015 年 10 月 26 日