

博时回报灵活配置混合型证券投资基金

2015 第三季度 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

81 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。

82 基金产品概况
基金名称:博时回报灵活配置混合型证券投资基金
基金代码:050022

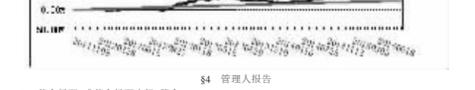
83 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 基金净值表现 (Fund Performance). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期公允价值变动收益, etc.

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

Table comparing fund performance with benchmark for 2015年7月1日至2015年9月30日.

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



84 管理人报告
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 职务: 任职日期: 离任日期: 证券从业年限: 说明

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》及其各项实施细则...

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管理制度...

4.4 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内本基金投资策略和业绩表现说明...

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值变动情况的说明
截至2015年9月30日,本基金份额净值为1.462元,累计份额净值为1.578元,报告期内净值增长率为-19.58%...

85 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): 占基金资产净值比例(%)

5.2 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(%)

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: 公允价值(元): 占基金资产净值比例(%)

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(%)

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: 公允价值(元): 占基金资产净值比例(%)

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
报告期末本基金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
报告期末本基金未持有权证投资。

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 其他各项资产构成
序号: 项目: 金额(元): 占基金资产净值比例(%)

86 开放式基金资产净值变动
单位: 份

87 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
报告期末基金管理人持有本基金份额

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

88 影响投资决策的其他重要信息
博时基金管理有限公司是中国境内首批成立的三家基金管理公司之一,“为国民创造财富”是博时的使命...

89 备查文件目录
9.1 中国证监会批准博时回报灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
9.1.1(博时)回报灵活配置混合型证券投资基金合同

9.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

88 影响投资决策的其他重要信息
博时基金管理有限公司是中国境内首批成立的三家基金管理公司之一,“为国民创造财富”是博时的使命...

89 备查文件目录
9.1 中国证监会批准博时回报灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
9.1.1(博时)回报灵活配置混合型证券投资基金合同

9.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

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

博时价值增长贰号证券投资基金

2015 第三季度 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

81 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。

82 基金产品概况
基金名称:博时价值增长贰号证券投资基金
基金代码:050020

83 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 基金净值表现 (Fund Performance). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期公允价值变动收益, etc.

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

Table comparing fund performance with benchmark for 2015年7月1日至2015年9月30日.

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



84 管理人报告
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 职务: 任职日期: 离任日期: 证券从业年限: 说明

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》及其各项实施细则...

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管理制度...

4.4 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内本基金投资策略和业绩表现说明...

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值变动情况的说明
截至2015年9月30日,本基金份额净值为0.672元,累计份额净值为2.127元,报告期内净值增长率为-21.96%...

85 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): 占基金资产净值比例(%)

5.2 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(%)

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: 公允价值(元): 占基金资产净值比例(%)

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(%)

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: 公允价值(元): 占基金资产净值比例(%)

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
报告期末本基金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
报告期末本基金未持有权证投资。

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 其他各项资产构成
序号: 项目: 金额(元): 占基金资产净值比例(%)

86 开放式基金资产净值变动
单位: 份

87 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
报告期末基金管理人持有本基金份额

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

88 影响投资决策的其他重要信息
博时基金管理有限公司是中国境内首批成立的三家基金管理公司之一,“为国民创造财富”是博时的使命...

89 备查文件目录
9.1 中国证监会批准博时价值增长贰号证券投资基金设立的文件
9.1.1(博时)价值增长贰号证券投资基金合同

9.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

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

博时价值增长证券投资基金

2015 第三季度 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

81 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。

82 基金产品概况
基金名称:博时价值增长证券投资基金
基金代码:050001

83 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 基金净值表现 (Fund Performance). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期公允价值变动收益, etc.

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

Table comparing fund performance with benchmark for 2015年7月1日至2015年9月30日.

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



84 管理人报告
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 职务: 任职日期: 离任日期: 证券从业年限: 说明

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》及其各项实施细则...

81 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。

82 基金产品概况
基金名称:博时价值增长证券投资基金
基金代码:050001

83 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 基金净值表现 (Fund Performance). Rows include 1.本期已实现收益, 2.本期公允价值变动收益, etc.

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

Table comparing fund performance with benchmark for 2015年7月1日至2015年9月30日.

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



84 管理人报告
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名: 职务: 任职日期: 离任日期: 证券从业年限: 说明

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》及其各项实施细则...

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管理制度...

4.4 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。

5.2 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(%)

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: 公允价值(元): 占基金资产净值比例(%)

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(%)

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: 公允价值(元): 占基金资产净值比例(%)

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
报告期末本基金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
报告期末本基金未持有权证投资。

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 其他各项资产构成
序号: 项目: 金额(元): 占基金资产净值比例(%)

86 开放式基金资产净值变动
单位: 份

87 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
报告期末基金管理人持有本基金份额

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

88 影响投资决策的其他重要信息
博时基金管理有限公司是中国境内首批成立的三家基金管理公司之一,“为国民创造财富”是博时的使命...

89 备查文件目录
9.1 中国证监会批准博时价值增长贰号证券投资基金设立的文件
9.1.1(博时)价值增长贰号证券投资基金合同

9.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

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

9.4 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.5 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.6 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.8 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.9 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.10 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.11 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.12 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.13 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.14 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.15 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.16 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.17 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.18 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.19 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.20 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.21 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.22 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.23 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.24 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.25 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.26 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况

9.27 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回或买入本基金的情况