

博时互联网主题灵活配置混合型  
证券投资基金  
2015 年第 2 季度报告  
2015 年 6 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：2015 年 7 月 18 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 7 月 17 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 2015 年 4 月 28 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	博时互联网主题混合
基金主代码	001125
交易代码	001125
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 28 日
报告期末基金份额总额	3,721,044,872.15 份
投资目标	在严格控制风险的前提下,通过积极挖掘成长性行业和企业所蕴含的投资机会,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	基金管理人基于对经济周期及资产价格发展变化的理解,通过定性和定量的方法分析宏观经济,资本市场,政策导向等各方面因素,建立基金管理人对各大类资产收益的绝对或相对预期,进而作出对各大类资产配置权重的判断。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期收益和预期风险低于股票型基金,高于货币市场基金和债券型基金,具有中高等风险/收益的特征。
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

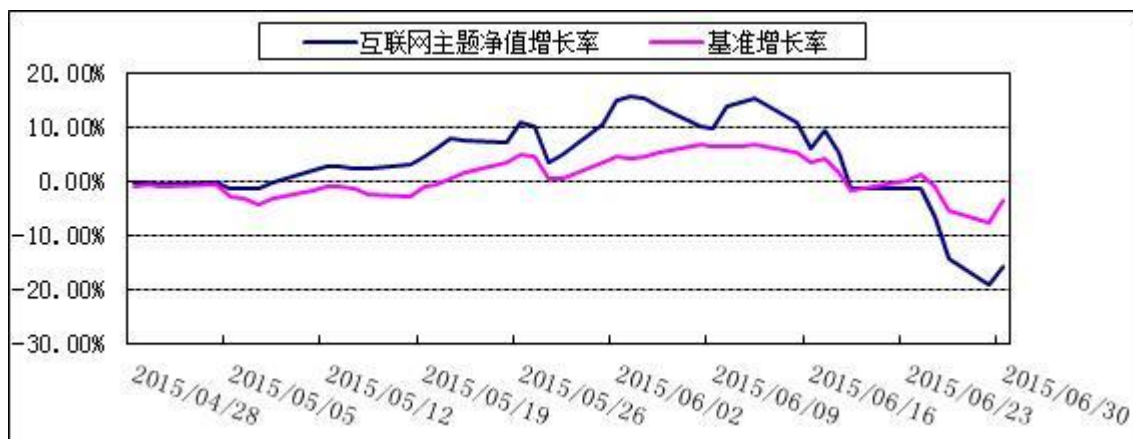
主要财务指标	报告期
	(2015 年 4 月 28 日 (基金合同生效日) - 2015 年 6 月 30 日)
1. 本期已实现收益	-363,689,906.99
2. 本期利润	-613,873,656.74
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1563
4. 期末基金资产净值	3,137,257,974.38
5. 期末基金份额净值	0.843

### 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	-15.70%	2.97%	-3.55%	1.76%	-12.15%	1.21%

#### 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



注：本基金合同于 2015 年 4 月 28 日生效。按照本基金的基金合同规定，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本基金合同第十二条（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。

## § 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		
招扬	基金经理	2015-04-28	-	8	2004 至 2007 年曾在华为技术有限公司工作。2007 年加入博时基金管理有限公司，历任研究员、资本品研究组主管兼研究员、投资经理。现任特定资产管理部副总经理兼博时裕益灵活配置混合型

					证券投资基金、博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
张雪川	基金经理	2015-04-28	-	6	1999 年起先后在巨龙公司、华创证券工作。2013 年加入博时基金管理有限公司，历任高级研究员、资深研究员、投资经理。现任博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

#### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

因为政府对多层次资本市场的布局和决心，导致创新型企业从多种渠道获得融资的门槛大幅度降低，例如新三板和即将到来的注册制，同时一批正在拆除 VIE 结构即将登陆国内的创新型企业，都对 A 股现有的互联网概念或者转型公司不管是从并购还是对比的角度，都形成了种种估值压力。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.843 元，份额累计净值为 0.843 元，报告期内净值增长率为-15.70%，同期业绩基准涨幅为-3.55%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来在 A 股的创新型互联网企业将逐渐分化，强者恒强，过去互联网概念黄袍加身

就能点石成金的时代过去了，大浪淘沙的日子来临，互联网仍然在改变我们的生活方式和工作方式，但是脱离地心引力的东西终归要回归本质。

未来一个季度的市场更多可能是重实质，重业绩，轻概念，市场的狂热期已经过去，放弃幻想，精挑细选。

#### 4.7 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	2,864,986,879.12	62.89
	其中：股票	2,864,986,879.12	62.89
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	1,681,830,067.34	36.92
7	其他各项资产	9,018,199.18	0.20
8	合计	4,555,835,145.64	100.00

### 5.2 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	169,321,655.87	5.40
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,508,904,937.55	48.10
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	1,062,314,290.21	33.86
J	金融业	-	-
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	74,628,925.41	2.38
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	49,817,070.08	1.59
S	综合	-	-
	合计	2,864,986,879.12	91.32

### 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	300059	东方财富	4,499,921	283,900,015.89	9.05
2	002268	卫士通	2,499,921	200,343,668.94	6.39
3	600804	鹏博士	5,999,994	179,159,820.84	5.71
4	002250	联化科技	7,499,963	167,999,171.20	5.35
5	300431	暴风科技	719,892	152,221,163.40	4.85
6	300032	金龙机电	4,147,813	142,352,942.16	4.54
7	300392	腾信股份	978,246	130,830,620.04	4.17
8	600105	永鼎股份	5,186,830	118,052,250.80	3.76
9	002450	康得新	3,349,830	102,504,798.00	3.27
10	002049	同方国芯	2,099,929	100,796,592.00	3.21

### 5.4 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。

### 5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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。

### 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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,130,710.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	138,907.68
5	应收申购款	7,748,580.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,018,199.18

### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002268	卫士通	200,343,668.94	6.39	公告重大事项
2	300431	暴风科技	152,221,163.40	4.85	公告重大事项
3	300392	腾信股份	130,830,620.04	4.17	公告重大事项

### 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

基金合同生效日基金份额总额	3,910,574,633.74
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	911,457,089.73
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,100,986,851.32
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,721,044,872.15

## § 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 6 月 30 日，博时基金公司共管理七十只开放式基金，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 3027.86 亿元人民币，其中公募基金资产规模逾 1317.35 亿元人民币，累计分红超过 664.83 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，标准股票型基金中，截至 6 月 30 日，博时创业成长股票基金及博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在 379 只标准型股票基金中分别排名前 1/3 和前 1/2；博时深证基本面 200ETF 及联接基金今年以来的净值增长率在 175 只指数股票型基金-标准指数股票基金及 46 只 ETF 联接基金中分别排名前 1/2 和前 1/3；混合基金-偏股型基金中，博时精选股票基金今年以来的收益率在同类型 36 只产品中排名前 1/3；混合基金-灵活配置型基金中，博时裕隆灵活配置混合及博时裕益灵活配置混合基金今年以来的净值增长率在 126 只同类型基金中分别排名前 1/3 和前 1/2。

固定收益方面，博时安丰 18 个月定期开放债券基金、博时优势收益信用债券、博时信用债纯债基金今年以来收益率在 71 只同类长期标准债券型基金中分别排名前 1/10、前 1/2 和前 1/2；博时上证企债 30ETF 今年以来的收益率在 18 只指数债券型基金-指数债券型基金(A 类)排名前 1/3。

### 2、其他大事件

2015 年 4 月 22 日，由上海证券报社主办的第十二届中国“金基金”奖的评选揭晓，博时主题行业股票证券投资基金(LOF)获得 5 年期股票型金基金奖。

## § 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互联网主题灵活配置混合型证券投资基金设立的文件



9.1.2 《博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

9.1.3 《博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

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 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

二〇一五年七月十八日