

博时现金收益证券投资基金

2009 第一季度报告

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2009年4月20日

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。

基金管理人博时基金管理有限公司根据本基金合同规定,于2009年4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,也不保证基金不承担本金损失。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。

本报告自2009年1月1日起至3月31日止。

基金名称:博时现金收益证券投资基金
交易代码:050003
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2004年1月16日
报告期末基金份额总额:16,427,306.02527份

投资目标:在保持低风险和流动性的前提下追求高于投资基准的回报。

投资策略:本基金根据短期利率的变动和市场利率的变化,积极主动地在债券资产和回购资产之间进行动态资产配置。

业绩比较基准:一年定期存款利率(税后)

风险收益特征:现金收益证券投资基金属于短期债券市场基础工具,由于这些金融工具的特性,目前现金收益证券投资基金的风险收益特征属于低风险、低收益。

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 2009 年 1 月 1 日-2009 年 3 月 31 日

1.本期已实现收益 71,125,964.67
2.本期利润 71,125,964.67
3.期末基金净值 16,427,306.02527

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 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 with 5 columns: 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, ①-③, ②-③

基金收益分配是按月分期进行的。

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

本基金合同于2004年1月16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3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十六条(三)投资范围、(四)资产配置策略的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的规定。

4.1 基金经理简介
姓名 职务 任职日期 离任日期

张勇 基金经理 2006-7-1 - 6年

2001年起先后在深圳市商业银行总行支行、深圳市商业银行总行支行、深圳市商业银行总行支行、2003年加入博时公司,历任博时基金交易、现金收益基金助理、现金收益基金助理、现金收益基金助理。

4.2 报告期内基金管理人及基金经理履行职责情况
在本报告期内,基金管理人严格执行了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《博时现金收益证券投资基金合同》和其他法律法规的规定,并未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易情况说明
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。

4.4 投资组合报告
4.4.1 本基金投资组合情况
报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

1 银行存款 9,743,726.22896 48.87
其中:活期存款 9,743,726.22896 48.87

2 买入返售金融资产 - -
其中:买断式回购的买入返售金融资产 - -

3 银行存单和结算备付金合计 4,280,638.8272 21.47

4 其他资产 5,913,155.76097 29.66

5 合计 19,937,540.82715 100

2.2 报告期末债券融资情况
项目 金额(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 报告期内债券融资余额 457,230,733.71105 19.06

其中:买断式回购融资 - -

2 报告期末债券融资余额 3,295,397.71230 19.82

其中:买断式回购融资 - -

3 银行存单和结算备付金合计 4,280,638.8272 21.47

4 其他资产 5,913,155.76097 29.66

5 合计 19,937,540.82715 100

2.3 报告期末基金资产组合情况
项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 10,650,933.36781 65.83

其中:股票 10,650,933.36781 65.83

2 固定收益投资 564,660.39690 3.49

其中:资产支持证券 564,660.39690 3.49

3 金融衍生品投资 8,051,177.55 0.05

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 银行存单和结算备付金合计 4,940,235.29395 30.53

6 其他资产 16,441,921.03 0.10

7 合计 16,180,322.15724 100.00

5.2 报告期末基金资产组合的行业分布情况
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 937,550,000.00 5.83

B 采掘业 1,969,282,364.92 12.25

C 制造业 1,652,615,506.77 10.28

其中:食品饮料 77,911,721.28 0.48

C8 医药、生物制品 77,911,721.28 0.48

C9 其他制造业 - -

D 电力、煤气及水的生产和供应业 879,596,988.28 5.47

E 建筑业 - -

F 交通运输、仓储业 2,383,668,048.40 14.82

G 信息技术业 709,114,247.12 4.41

H 批发和零售业 94,580,022.72 0.59

I 金融、保险业 2,370,586,720.05 14.74

J 房地产业 934,562,768.65 5.93

K 社会服务业 241,907,351.14 1.50

L 文化传播业 110,544,868.38 0.69

M 综合类 - -

合计 10,650,933,367.81 66.24

5.3 报告期末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 600016 大秦铁路 131,542,270 1,853,395,048.00 7.30

2 600036 招商银行 820,395,000.00 5.10

3 000002 万科A 786,600,000.00 4.89

4 600717 天津港 612,640,000.00 3.81

5 600875 东方电气 16,000,000 60,320,000.00 0.77

6 601398 工商银行 591,000,000.00 3.68

7 600928 中国石化 65,000,000 578,500,000.00 3.60

8 900009 长江电力 58,466,716 552,604,736.32 3.40

9 600009 上海机场 35,100,000 498,771,000.00 3.14

10 000001 浦发银行 27,000,000 430,380,000.00 2.68

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 国债 300,818,576.00 1.26

C5 电子 22,048,613.42 0.21

C6 金融、非金融 30,100,613.42 0.21

C7 机械、设备、仪表 1,652,615,506.77 10.28

C8 医药、生物制品 77,911,721.28 0.48

C9 其他制造业 - -

D 电力、煤气及水的生产和供应业 879,596,988.28 5.47

E 建筑业 - -

F 交通运输、仓储业 2,383,668,048.40 14.82

G 信息技术业 709,114,247.12 4.41

H 批发和零售业 94,580,022.72 0.59

I 金融、保险业 2,370,586,720.05 14.74

J 房地产业 934,562,768.65 5.93

K 社会服务业 241,907,351.14 1.50

L 文化传播业 110,544,868.38 0.69

M 综合类 - -

合计 10,650,933,367.81 66.24

5.5 报告期末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(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 050803 05中债11 2,500,000 235,675,000.00 1.47

2 060411 06农发11 2,000,000 204,000,000.00 1.27

3 022180 02国债18 500,000 53,960,000.00 0.34

4 080418 08央行18 500,000 50,110,000.00 0.31

5 120011 08央行11 239,130 20,835,396.90 0.13

5.6 报告期末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
本基金报告期末持有资产支持证券。

5.7 报告期末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
本基金报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 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。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号 项目 金额(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 14,220,182.43

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 预收 -

8 其他 -

合计 63,069,151.94

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 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 流通受限部分公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 600900 长江电力 552,604,736.32 3.44 公告重大事项

5.8.6 其他需要说明的重要事项
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。

5.8.7 其他资产构成

序号 项目 金额(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 14,220,182.43

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 预收 -

8 其他 -

合计 63,069,151.94

5.8.7 影响投资者决策的其他重要信息
博时基金管理人是国内首批成立的五家基金管理公司之一,为国民创造财富"博时的使命,博时的投资理念是"做价值的发现者"。目前,博时基金管理人旗下共管理11只开放式基金、3只封闭式基金、同时管理部分全国社保基金,以及多个企业年金基金。截至2009年3月31日,博时基金管理人管理的总资产1711亿元,是目前国内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全国名列前茅,累计分红超过人民币415亿元。

1) 为进一步提升投资者、非电子交易的服务水平,博时于今年2月份推出"博时基金手机网站",成为业内最早的推出手机基金交易的平台之一。投资者可通过手机上网访问http://qcbn.com,进行博时基金旗下高净值基金交易、咨询等业务,及查阅博时旗下基金最新净值和行情信息。上述手机基金业务包含申购、赎回、申购、赎回、转换、交易、分红、查询、收益查询、密码管理、账户查询、账户资料修改、修改分红方式、账户资料变更等众多功能。

2) 为提升客户服务水平,博时更好地支持环保,从今年3月起,博时在原来已经提供的季度、年度电子对账单服务的基础上,增加了月度电子对账单服务,除除季末当月月底外,每月月底,博时还将为所有订阅电子对账单的投资者增加月度电子对账单。

3) 自2009年1月1日起,博时基金"价值"为长期的2009年博时基金高峰论坛于今年3月份全面启动,作为博时基金旗下高端品牌系列活动之一,目前论坛已经在大连、成都、广州三地举办,广受专家学者的关注和好评,资本市场发展等话题更受到业界和投资者的广泛关注和讨论,除了投资者外,博时基金在论坛现场还举办了专题演讲,让更多的机构投资者了解"价值"中国"价值"2009年博时基金高峰论坛,分享专家的真知灼见。

2) 公司荣誉奖项
1) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

2) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

3) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

4) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

5) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

6) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

7) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

8) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

9) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

10) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

11) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

12) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

13) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

14) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

15) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

16) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

17) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

18) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

19) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

20) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

21) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

22) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

23) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

24) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

25) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

26) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

27) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

28) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

29) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

30) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

31) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

32) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

33) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

34) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

35) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

36) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

37) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。

38) 在2009年1月份揭晓的第六届中国基金金牛奖评选中,博时博时"金牛基金"的称号,基金裕隆、博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号,博时主题行业股票证券投资基金荣获"金牛基金"称号。