例 (%)

比例 %)

比例 %)

比例 %)

173,936,545.30

裕隆证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12月31日

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期;2010年1月20日
51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产带责任。基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值农现和股资组合报告等内容。保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。基金管理人术语以读定信用,勤龄尽于的原则管理和应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行细阅读本基金的招募说明书。本程与由财务给基本经验计

	§2 基金产品概况
基金简称	博时裕隆封闭
基金主代码	184692
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年 6 月 15 日
报告期末基金份额总额	3,000,000,000 份
	为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并主要通过投资于
投资目标	业绩能够保持长期可持续增长、从长远来看市场价值被低估的成长型上
1	市公司来实现基金的投资收益。
	本基金的投资组合应本着收益性、安全性、流动性的原则。依据上市公司
	的预期收益和发展潜力,通过投资于业绩能够保持长期可持续增长、从
LII 25to Athropia	长远来看市场价值被低估的成长型公司来实现基金长期的股票投资收
投资策略	益。通过综合国内国际经济环境、行业、公司和证券市场的相关因素,研
	定各类金融工具的投资组合比例,达到分散和降低投资风险,确保基金
	资产安全,谋求基金收益长期稳定的目的。
业绩比较基准	无
风险收益特征	本基金是一只偏股型的证券投资基金,属于中等风险品种。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

3.1 主要财务指标	50 工安州为海州和基金中国农机
3.1 工 宏州 571日4小	单位:人民币元
主要财务指标	报告期 2009 年 10 月 1 日-2009 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	111,234,544.24
2.本期利润	499,091,996.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.1664
4.期末基金资产净值	4,554,282,446.04
5.期末基金份额净值	1.5181
太期已实现收益指基金太期利息收入	投资收益,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的金额。2

本期已实现收益結基金本期利息收入,投资收益,其他收入,保含公允价值变动收益,用除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上。并则公允价值变效收益。 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, 计人费用后投资人的实际收益水平要低于所列数

1 本报告期基金	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	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	12.31%	3.26%	-	-	-	-
	阶段 过去三个月	阶段 净值增长率	阶段 净值增长率 净值增长率 标准差②	阶段 净值增长率 净值增长率 业绩比较基标准差② 过去三个月 12.31% 3.26% -	阶段 净值增长率 净值增长率 业绩比较基准收益率标准整② 小型 标准差② 准收益率标准差③ 过去三个月 12.31% 3.26% - -	阶段 净值增长率 净值增长率 业绩比较基本 业绩比较基准收益率标准差④ 过去三个月 12.31% 3.26% - - -

§4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年	说明	
X±Æ	RF(93'	任职日期	离任日期	限	150,19-1	
孙占军	基金经理	2008-2-20	-	8.5	1998起先后在宝山钢铁股份公司、 申银万国证券研究所、香港中信证 券研究有限公司工作。2005 年加 人博时公司、曾任研究员、研究员 基基金经理助理。现任基金裕隆 基金经理	

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明 在本程告期内,本基金管理人师整醒了,伊华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、豁隆证券投资基金基金合同外证他积长法律法规则规定,并本省诚实信用、勘勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产、为基金特有人谋求最大利益。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 的行为。 4.3 公平交易专项说明 4.31 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 征券投资基金管理公司公平交易制度指导意见 Yn公司制定的公平交易相关

。 4.32 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较 本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。 4.33 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

投资回顾; 担资回顾; 型季度国内经济复苏态势确立,固定资产投资持续高增长,周民消费高位运行,进出口也逐渐恢复。在经济向好和 流动性宽松的支持下,四季度上证纸指德荡向上,整个季度上涨 17.91%。分行业来看,业绩大幅度增长的汽车、家电涨幅 周前,而受到甲融资和调整影响给金融。地产表现落后。 四季度设有能续执行相对灵活的配置策略,在大类资产配置上,首先提高了股票的投资比例,并相应地降低了债券 和现金的配置。其次从行业配置上,增加了券商、有色、煤炭、钢实等受益于被策和通胀预期的行业,同时将低了银行、交 运和电力等防守性行业的配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现 载至 2009 年 12 月 31 日,本基金份额净值为 1.5181 元,份额累计净值为 4.3871 元。报告期内,本基金份额净值增长 率为 12.31%。周期上证请数据编为 17.91%。

序号	項目	金额 (元)	占基金总资产
17-5	坝日	SECTION OL)	的比例 %)
1	权益投资	3,222,948,952.86	70.54
	其中:股票	3,222,948,952.86	70.54
2	固定收益投资	945,968,000.00	20.70
	其中:债券	945,968,000.00	20.70
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	_	-
4	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	373,208,211.50	8.17
6	其他资产	27.110.084.39	0.59

4.00		615 H 10 FFM					占基金资产净
代码		行业类别			2	〉允价值 (元)	值比例 %)
A	农、林、牧、渔	ЯК					
В	采掘业				260,536,731.61		1 5.72
С	制造业				1,143,836,534.25		5 25.12
CO	食品、饮料					238,244,193.5	2 5.23
C1	纺织、服装、肠	女毛					
C2	木材、家具						
C3	造纸、印刷						_
C4	石油、化学、剪	月17岁、卯日末4				86,607,437.8	2 1.90
C5	电子	and Commercial				87,000,000.0	
C6	金属、非金属					363,367,637.7	
C7	机械、设备、化					368,617,265.1	
C8	医药、生物制					30010171203.1	. 0.0.
C99	其他制造业	ШП					
D		水的生产和供	F etv.III			64,243,121.4	0 1.41
E	建筑业	-3-H3-E) -(HD)	constant.			04,243,121.4	1.41
F	交通运输、仓	6年417					
		INI NY.				271 051 000 2	4
G	信息技术业	77 EI				271,851,089.2	_
Н	批发和零售					378,807,731.4	_
I	金融、保险业					773,593,119.1	
J	房地产业					131,523,759.2	
K	社会服务业					153,826,866.5	0 3.38
L	传播与文化产	突不					
M	综合类					44,730,000.0	
	合计					3,222,948,952.8	6 70.77
3 报告	期末按公允价值	值占基金资产	净值比例:	大小排	字的前十名股	票投资明细	
序号	股票代码	股票名称	数量 (段)	2	公允价值 (元)	占基金资产净 值比例 %)
1	601939	建设银行	37,99	9,922		235,219,517.1	8 5.16
2	600739	辽宁成大	5,73	3,283		218,380,749.47	
3	000001	深发展 A	8,54	8,622		208,329,918.14	
4	002024	苏宁电器	7,72	0,259		160,426,982.02	
5	000568	泸州老窖	3,99	9,861	156,154,573.44		4 3.43
6	000401	冀东水泥	7,77	3,829		150,034,899.7	0 3.29
7	600031	三一重工	3,29	4,765		121,280,299.6	5 2.66
8	000960	锡业股份	3,92	9,961		121,199,997.2	4 2.66
9	600050	中国联通	16,59	9,910		121,013,343.9	0 2.66
10	600547	山东黄金	1,50	0,000		120,450,000.0	0 2.64
4 报告	朝末按债券品	种分类的债券	投资组合				<u> </u>
序号	债券品种	.,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,	104000000000000000000000000000000000000		公允价值 元)		占基金资产净 值比例 %)
1	国家债券				102,290,000.00		
2	央行票据				813,672,000.00		
3	金融债券				30.006.000.00		0.66
	其中:政策性	金融债			30,006,000.00		0.66
4	企业债券						-
5	企业短期融资	计学					
6	可转债				_		-
7	其他						
8 5 担告:1	合计 期末按公允价f	估上其全资产	净值比例-	た小排	夕 的前五夕梅	945,968,000.0	0 20.77
序号	债券代码	自口 密 並 页) 债券名			女量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净
							值比例 %)
1	0801014	08央票			3.000.000	307 - 800 - 000 .0	
3	0801017	08央票			1,600,000	164,240,000.0	
_	0801020 010110	08央票 21国信			1,000,000	102,680,000.0	
4							

5.8投资组合报告附注 5.8.1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

序号	名称	金額 (元)
1	存出保证金	774.294.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,335,790.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	共他	-
9	合计	27,110,084.39

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末未持有的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 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

单位:份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	6,000,000
报告期期间买入总份额	-
报告期期间卖出总份额	-
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	6,000,000
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例 66)	0.20
§7 影响投资者决策的其他国	要信息

3 影倫平衡型基金方面. 据银河证券基金研究中心统计,截止到 2009 年 12 月 31 日,博时平衡配置基金过去一年的1增长率位居同类基金的第5,并获得了银河证券三年期五星基金的评级。

净值增长率位居同类基金印第5,开铁房。1款内证券——中州卫品高级居9月75%。 2.客户服务 2.客户服务 2.8户服务 2.2009 年 4 季度,博时公司新开通了交通银行借记卡的网上直销交易功能,持有交行借记卡的客户可以通过博时 公司网站办理基公制版,申职。定期转换、赎回。转换。变更分红方式常宜销农易,体验费率优惠、赎回款到账速度快等多 項直销网站的交易优势。截至 2009 年 4 季度末,博时网上直销已经开通了11 种网上交易渠道,更加方便了投资者体验 足不出户的风上投资理财服务。 2 为了回馈博时忠实的电子对账单用户。感谢持有人的环保爱心之举,筹年度有采了[阅太行动"已拉开帷幕,在 2010 年 2 月 1 日之前,所有取消纸质对账单并订阅电子规账单的博时客户,均有两重机会赢取、客迎走新审"的丰度 奖品。

3.公司宋警 1 2009 年 12 月 23 日,在由搜狐阿主办的 2009 搜狐金融理财网络盛典中,博时基金荣获 2009 年最有影响力基金 品牌奖"奖师。 4.其他大事件 1)博时上证超级大陆 ETF 及其联接基金首募顺利结束并于 2009 年 12 月 29 日成立,其中超级大盘 ETF 募資 14.06

8.1 备查文件目录 8.1.1 中国证监会批准裕隆证券投资基金设立的文件

8.1.2 俗隆证券投资基金基金合同》 8.1.3 俗隆证券投资基金托管协议》 8.1.4 基金管理人业务资格批件、营业 8.1.5 裕隆证券投资基金各年度审计报告正本 8.1.6 报告期内裕隆证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

博时新兴成长股票型证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12月31日

2009年
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
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出事期:2010年1月20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。 砌能和完整性系担个别及连带责任。 基金性管人交通能行股份有限公司根据本基金合同规定。于2010年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现积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。 基金管理人所混论域实信用,勤勉尽册的原则管理和运用基金统产。但不保证基金一定盈利。 基金的过生地纳井不代表其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策则运行相阅读本基金的招募说明书。

报告期日 2009 年 10 月 1 日起	至 12 月 51 日正。
基金简称	博时新兴成长股票
基金主代码	050009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年7月6日
报告期末基金份额总额	23,295,883,057.26 份
投资目标	基于中国经济正处于长期稳定增长周期,本基金通过深入研究并积极 投资于全市场各类行业中的新火高速成长企业,力争为基金份额持有 人获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将通过 阻上而下"的宏观分析。以及逻程分析与证据分析相对 完的方法。在坚聚,佛养和奥金等产"也之间进行配置。本基金将分 析和预测众多宏观经济变量,包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对 大平和增长率、利率水平互连势等,并关注国家附近、税收、货币、汇率 以及股权分重位未宣统和其它能等功级效等。本基金特在武基础 上决定股票。固定收益证券和现金等大类资产在给定区间内的功态配 置。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于预期风险收益相对较高的基金品种。其预期风险和预期收益均高于债券型基金。
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

1 主要财务指标	§3 王要财务指标和基金净值表现
1 土安州 労伯怀	单位:人民币元
主要财务指标	报告期 2009年10月1日-2009年12月31日)
1.本期已实现收益	600,269,955.71
2.本期利润	3,191,035,743.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.1333
4.期末基金资产净值	22,461,337,025.02
5.期末基金份额净值	0.964

3.	2.1 本报告期基金	定份额净值增长	率及其与同期』	/绩比较基准收	益率的比较			
	阶段	净值增长率	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	15.73%	1.49%	15.23%	1.41%	0.50%	0.08%	
2	2.2.4 白世春人同此境巴東世界田井為佐藤と東京計五世に同期北海は位世和田子東京計場は位							

本基金由原封闭式基金-格华证券投资基金转型而来、本基金合同于2007年7月6日生效。本基金于2007年8月3 日完成了基金份额的集中申取,并向中国证监会接受了统于博时基金管理有限公司申请延长顺中新兴成长股票型证券 投资基金证券投资比例调整的部尚示》,将基金投资比例调整明由原原的0个交易日延长至一分月,自集中申购份额确 认之日起3个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十五条"C 投资范围"、"七 投资禁止行为与限制"的有关 约定。顺整的基本财务项资产促置比例符合基金合同第二次

4.1 基金经理 (成基金经理小组)简介

姓名 职务	任本基金的基金	金经理期限	证券从业年	说明	
X土七1 和バラデ	任职日期	离任日期	限	10093	
李培刚 基金经理	2008-7-2	-	9	1992年起先后在黑龙江省 水电建设管理局、北京国际 系统控制公司、招商证券研 发中心、华安基金研究部工 作。2005 年加入博时公司, 历任研究员、研究部副总经 理兼任研究员。现任博时新 兴成长基金基金经理。	
刘彦春 基金经理	2008-7-2	-	7.5	2002起先后在汉唐证券研究所、香港中信投资研究有 院公司任行业研究员。2006 年加人博时公司,历任研究 员、研究员兼基金经理助 理。现任博时新兴成长基金 基金经理。	
报告期内本基金运作遵规等					

型证券投资基金基金合同》和其他相关法语法规的规定,并举着被决定用,通知是"发生与实验证如,我可能对以成认及实现证券投资基金基金合同》和其他相关法语法规的规定,并举着被决定用,遇她没责,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公平交易专项设明 和运用海岛。 选持有人利益的行为。 43、公平交易专项战明 43、公平交易专项战明 43、公平交易制度的执行情况 43、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。征券投资基金管理公司公平交易制度指导意见,独公司制定的公平交易相关制

·福爱品。 4.4.2 报告期内基金的业绩表现 载至 2009 年 12 月 31 日,本基金份额净值为 0.964 元,份额累计净值为 3.617 元。报告期内,本基金份额净值增长率 为 15.73%。铜即或绩基地增失为 15.23%。

序号	项目	金額 (元)	占基金总资产的 比例 (%)
1	权益投资	20,520,577,176.11	90.39
	其中:股票	20,520,577,176.11	90.39
2	固定收益投资	6,846,157.70	0.03
	其中:债券	6,846,157.70	0.03
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买人返售金融资产	-	_
	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	2,001,854,483.34	8.82
6	其他资产	173,936,545.30	0.77
7	수난	22 702 214 262 45	100.00

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序

股票名称

序号 股票代码

序号 债券代码

902,854,768.5 6,265,371,234.64 912,773,472.00 19,830.0 688,851,881. 1,290,464,524.48 7,386,436,899.13

数量(段)

公允价值 (元)

公允价值(元)

公允价值(元)

主要财务指标	§3 主要财务指标和基金净值表现
土安州 労10100	单位:人民币元
上要财务指标	报告期 2009年10月1日-2009年12月31日)
.本期已实现收益	600,269,955.71
.本期利润	3,191,035,743.79
.加权平均基金份额本期利润	0.1333
.期末基金资产净值	22,461,337,025.02
.期末基金份额净值	0.964

0.964 本期已実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 加除相关费用后的余额,本期利 海为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 上述基金业费排标不包括持有人交易基金的各项费用,计人费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。 3.3 基金净值表现

西洋转债 4.250 627.895 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约 寺有资产支持证券。 值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

债券名称

5.8.2 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。

数量 (张)

7 持種費用 8 其他 9 合计 5.8.4 报告期未持有的处于转费期的可转换债券明细 5.8.4 股告别未刊有19.4 了在欧州加宁省交际间分钟19.4 本基金本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的设于本基金和发告期末前十名股票中存在流通受限情况的设于本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在

间可能存在尾差。 §6 开放式基金份额变动

24,479,627,042.67 报告期期间基金总申购份额 报告期期间基金总赎回份额 1,417,439,683.48

报告期期末基金份額总額 87 影响投资者决策的其他重要信息 23,295,883,057.26

列前茅。
1、业绩表现
1) 封闭式基金方面,据银河证券基金研究中心统计,截止到 2009 年 12 月 31 日、博时裕隆封闭过去三年的净值增长
率为 128.01%,在所有前闭式基金中排系器。并获得了银河证券三年期五星基金的呼级。
2 股票型基金方面,WRD 资讯数据显示,以最后的基金类解布进壳到边,成立于 2006 年 12 月 31 日之前的可比股票型基金共有 133 只,截止到 2009 年 12 月 31 日,博时主题行业今年以来的净值增长率已经超过 70%,获得了银河证券

2. 客户服务
2. 客户

3、公司荣誉 1 2009 年 12 月 23 日,在由搜狐网主办的 2009 搜狐金融理财网络盛典中,博时基金荣获 2009 年最有影响力基金品

開發了樂頭。 4.其他大事件 1)物明上证超級大盘 ETF 及其联接基金首與順利結束并于 2009 年 12 月 29 日成立,其中超級大盘 ETF 寡資 14.06 1) 押計上並超級大區 EIF 及共同法院部第二章 :超級大量 EIF 联接基金赛 19.66 亿元。 2 淮朝村和上交所等相关机构联合于 2009 年 12 月 4 日在上海举行 "土证超級大盘 EIF 发行专题研讨会"。 88 **备查文件目录** 8.1 备查文件目录 8.1.1 中国证明会组织

8.11 中国正监会批准博时新兴成长股票型证券投资基金设立的文件 8.1.1 中国正监会批准博时新兴成长股票型证券投资基金基金台同》 8.1.3 博时新兴成长股票型证券投资基金基金台同》 8.1.3 博时新兴成长股票型证券投资基金基金台的议》

8.1.5 博时新兴成长股票型证券投资基金各年度审计报告正本 8.1.6 报告期内博时新兴成长股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿 8.2 存放地点: 基金管理人、基金托管人处

8.3 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 客户服务中心电话:95105568 晚长途话费)

基金管理人:博时基金管理有限公司 基金托管人:交诵银行股份有限公司 报告送出日期:2010年1月20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、误导性陈述成重大遗漏,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。 基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定。于2010年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现

孫盛江自入《金明记》(中国《公司代政中帝盛至日本》)。 接徵自合报告等内容,保证复核内容不存在磨留记载。 誤學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。

本报告中财务资料未经审计。 本报告期自 2009 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。 §2 **基金产品概况**

博时现金收益货币 050003
050003
契约型开放式
2004年1月16日
15,134,457,407.06 份
在保证低风险和高流动性的前提下获得高于投资基准的回报。
本基金根据短期利率的变动和市场格局的变化,积极主动地在债券资
产和回购资产之间进行动态的资产配置。
活期存款利率 (税后)
现金收益证券投资基金投资于短期资金市场基础工具,由于这些金融
工具的特点,因此整个基金的风险处于较低的水平。但是,本基金依
然处于各种风险因素的暴露之中,包括利率风险、再投资风险、信用风
险、操作风险、政策风险和通货膨胀风险等等。
博时基金管理有限公司
交通银行股份有限公司

§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 2009 年 10 月 1 日-2009 年 12 月 31 日)
	1.本期已实现收益	54,089,489.61
	2.本期利润	54,089,489.61
	3.期末基金资产净值	15,134,457,407.06
78	期口空間 佐は上全木相利 自 大	投资收益 甘油收入 医变分分价值率到收益 知险相关费用后的交额 太阳

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

3.	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		
	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	0.4770%	0.0091%	0.0920%	0.0000%	0.3850%	0.0091%

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 合比例符合本基金合同第十六条 仨)投资范围、(八)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

博时现金收益证券投资基金 第四季度报告

任本基金的基金经理期限 证券从』 任职日期 寓任日期 银行北清支行、南京市商业 2003年加入博时公司,历(张勇 基金经理 债券交易员、现金收益基金 S理助理兼任债券交易员 任现金收益基金经理、博 4. 管理人对报告期内本基金运作遵则字信情况说明 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)及其名项实施细则、专时理企收益证券 投资基金基金问 网耳虎帆柱法律法规的规定。并本常诚实信用、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,为基金特有人谋求最大利益。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,没有指害基金特有 人裁结的行为。

743 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易制度的执行情况 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

43.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较 本基金与本基金管理人断下的其他投资组合的投资风格不同。 43.3 异常交易行为传 5项间则 报告期内未发现本基金存在异常交易行为。 44.4 报告期内基金投资策略和运营表现说明 44.4 报告期内基金投资策略和运作分析

1.行情回顾 4.季度、CPI 转正,表明我们已经彻底告别了通缩时代,其他各项宏观指标也正沿着大家的预期不断的好。回顾 4.季度 市场。信用产品和利率产品收益率均有所上升,债券市场在不断出台的宏观数据下,看不到大多的投资机会。短期利 对上升舰度不大。 2.投资退影 2.投资思路 4季度短期刺率虽然上升幅度不大,但是正由于这个原因,使得大家认为未来短期利率上升是大概率事件。因此,我们 2图持谁慎的投资思路,少量买人信用产品,保留大量现金,通过短期存款进行现金管理。

坚持谨慎即投资退路,20堂头人信用产品,保管大画观题,加以起明存40年11903年回。 3.市场展型与投资策略 4.季度的债券市场,可以说是流动性东裕与宏观数据向好这两者之间的角力,结果带来的是收益率曲线的小幅上升。 着经济的企稳,流动性将会不断减弱,紧缩政策的出台只是时间早晚的问题,现金为王"仍然是本基金下一季度的主

運路。 4.4.2报告期内基金的业绩表现 本基金本报告期内净值增长率为 0.48%,业绩基准增长率为 0.09%.

字号	项目	金額 (元)	占基金总资产的比
	PPTabalife Af DP Ma		例 %)
1	固定收益投资	3,682,557,185.3	
	其中:债券	3,682,557,185.3	2 24.32
	资产支持证券		
2	买人返售金融资产	2,342,844,002.5	8 15.47
	其中:买断式回购的买人返售金融资		
	j ^{iz}	1,158,842,302.5	8 7.65
3	银行存款和结算备付金合计	8,321,011,237.4	8 54.95
4	其他资产	796,349,976.7	0 5.26
5	合计	15,142,762,402.0	8 100.00
告期信	责券回购融资情况		
号	项目	占基金资产净值比例	il (%)
	报告期内债券回购融资余额		0.87
1	其中:买断式回购融资		
	**** F-1	A stee	占基金资产净值的比
号	项目	金額	例 (%)
	报告期末债券回购融资余额	-	-
2	其中:买断式回购融资	_	-

股告期内债券回购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净值比例的简单平均值。 请券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明 比本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。 3.3 基金投资组合平均剩余期限基本情况 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 剩余期限未超过 180 天

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	50.64	
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.32	_
2	30天 含)—60天	0.80	_
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	_
3	60天 含)—90 天	24.41	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.59	_
4	90天 含)—180 天	2.77	_
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.32	_
5	180天 含)-397天 含)	16.18	_
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	_
	合计	94.80	_
设告期:	末按券种品种分类的债券投资组合		
			F-H-A 36-2-12, H-

序号		债券品种	摊会	余成本 忨)	占基金资产净值 的比例 (%)
1	国家债券			-	-
2	央行票据			493,870,949.53	3.26
3	金融债券			1,285,745,065.25	8.50
	其中:政策性	金融债		1,085,562,990.19	7.17
4	企业债券			248,754,770.70	1.64
5	企业短期融资	6券		1,654,186,399.84	10.93
6	其他			-	-
7	合计			3,682,557,185.32	24.33
8	剩余存续期起 券	图过 397 天的浮动利率	债	943,372,559.00	6.23
5 报告期末	· 按摊余成本:	占基金资产净值比例大	小排名的前十名债务	 學投资明细	
序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本 (元)	占基金资产净值的 比例 %)
1	0901044	09央行票据 44	5,000,000	493,870,949.53	3.26
2	070211	07国开 11	4,400,000	444,347,833.24	2.94
3	050603	05中行 02 浮	2,000,000	200,182,075.06	1.32
4	0980147	09中航工债 02	2,000,000	200,000,000.00	1.32
5	090223	09国开 23	2,000,000	199,986,597.68	1.32
6	050227	05国开 27	1,700,000	170,712,616.03	1.13
7	0981142	09云铜 CP01	1,600,000	159,898,652.69	1.06
8	0981140	09方正 CP02	1,500,000	149,952,954.98	0.99
9	070420	07农发 20	1,200,000	120,437,385.99	0.80
10	090218	09国开 18	1,000,000	99,990,677.25	0.66

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25% 含 1-0.5%间的次数	0岁
报告期内偏离度的最高值	0.2000%
报告期内偏离度的最低值	0.0500%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1400%

5.8.1 基金计价方法均别 本基金采用排除余成本法计价,即计价对象以买人成本列示,按实际利率并考虑其买人时的溢价与折价,在其剩余期限 内轉銷,每日计划收益。本基金采用商证价额价值。基金账面份额价值经条限付 1.00 元。 5.8.2 本基金在报告期内不存在特有剩余期限小于 397 完恒剩余存续期超过 397 无的浮息债的摊余成本超过基金资 净值 20%的语况。 5.8.3 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 贯、处罚。

5.8.4 其他资产构成 金额 伝 2 应收证券清算款 3 应收利息 30,584,089.1 765,765,887.5 6 待摊费用
7 其他
8 合计 8 | 合计 5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。 86 开放式基金份额变动 796,349,976.70

11,729,684,197.47 报告期期间基金总申购份额 20,558,816,499.81 报告期期末基金份额总额 15,134,457,407.06 §7 影响投资者决策的其他重要信息 87 影响投資者決策的其他重要信息 期时基金管理有限公司是中国內地首計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 资理全量 數投资价值的发现者"。截至 2009 年 12 月 31 日、博时基金公司共管理十五 只开放式基金和三具招式基金,并 且受益国社会保障基金理事务会并管理部分计量法金。以及今企业年金账户。资产管理总典储金 2005 亿元。累计分红超过人民币 436 亿元。博时基金公司是自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回业中名列前 进入民币 436 亿元。博时基金公司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回业中名列前

[31] 1732。 衛型基金方面,据银河证券基金研究中心统计,截止到 2009 年 12 月 31 日,博时平衡配置基金过去一年的净 [司类基金的第5,并获得了银河证券三年期五星基金的评级。

3 发现所干烟空热盘女用。锦德用业务盐或时火中心统计。截止到 2009 年 12 月 3 日 1。即时平侧电温金壶过去一年的伊健附朱章伦国民类盘伯斯等 5. 并获得了银矿市场产学年期互届基金的评级。
2 客户服务
1 2009 年 4 季度,博申公司新开通了交通银行借记卡的网上直销交易功能。持有交行借记卡的客户可以通过博时公司网站办理基金认购。申购。定期转换。赎回、转换、变更分红方式等直销交易、体验费率优惠、赎回款钢速速度快等多项直销网路的交易优势。 截至 2009 年 4 季度末,博时网上直销已经开通了11 中网上交易展道,更加方便了投资者体验足一户的网上投资理财服务。
2 为了回馈赠申建宝治的电子对账单用户。感谢持有人的环保受心之举。 筹度度有奖订阅人行动"已处开槽墓"在 2010 年 2 月 1 日之前,所有取消纸取状帐单并订阅电子对账单的博业实产,均有押重机会赢取。 警迅免废罪产的丰厚奖品。
3 作为博时基金旗下高端品牌系列活动之一,指公平国2 价值"高端论是四季度在广州、北京、北阳、石家庄、青岛、苏州等地共举力,上场活动。 海市盖家或宏观经济、资本市场等活题发表演评,并结合当前市场动态与到场客户进行了深入提出的交流、受到投资者热观欢迎。
3 公司可读

3、公司荣誉 12009年12月23日,在由搜狐网主办的 2009 搜狐金融理财网络盛典中,博时基金荣获 2009年最有影响力基金品牌奖"奖项。

医"安迈克"。 4.1北使大事件 1)即时上证超级大盘 ETF 及其联接基金首募顺利结束并于 2009 年 12 月 29 日成立,其中超级大盘 ETF 募资 14.06 亿 超级大盘 ETF 联接基金募资 19.06 亿元。 2 淮朝时和上交府等相关机构联合于 2009 年 12 月 4 日在上海举行"上证超级大盘 ETF 发行专题研讨会"。 88 备查文件目录 8.1 备查文件目录

8.2 存放地点: 基金管理人、基金托管人处 添蓝自述人给她以自己分 & 查園內式 投资者可在企业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件 投资者对本提告书如有疑问,可答询本基金管理人博时基金管理有限公司 客户服券中心电话;95105568 晚长途话费

符合基金合同约定 4.1 基金经理 (或基金经理小组)简介

§4 管理人报告