

裕隆证券投资基金 2010 第三季度报告

2010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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2010年10月26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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年10月25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,保证复核数字不存在虚假记载、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2010年7月1日起至9月30日止。

2 基金产品概况

基金简称 博时上证80ETF
基金代码 184692
交易代码 184692
基金运作方式 契约型开放式
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
投资目标 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上证80指数成份股实现基金的投资目标。
投资策略 本基金采取完全复制法,投资于上证80指数的成份股,跟踪该指数的表现,力求跟踪该指数的净值增长率,并力争超越该指数的净值增长率。本基金投资于上证80指数的成份股资产不低于基金资产净值的95%。
业绩比较基准 无
风险收益特征 本基金为跟踪指数的证券投资基金,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 主要财务指标和基金净值表现

| 主要财务指标 | 报告期末2010年7月1日至2010年9月30日 |
|----------------|--------------------------|
| 1.本期已实现收益 | 15,287,483.37 |
| 2.本期利润 | 548,973,736.85 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1830 |
| 4.期末基金份额净值 | 3.613,227,700.30 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.2044 |

3.2 基金净值表现
与业绩比较基准业绩增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较
过去三个月 17.92% 2.01%

4 基金管理人

| 姓名 | 职务 | 任本基金基金经理年限 | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------|------------|--------|---|
| 孙克军 | 基金经理 | 2008-2-20 | - | 1998年起先后在宝钢钢铁股份公司、中银国际证券有限公司、博时基金管理有限公司工作,2005年加入博时基金,曾任研究员,2008年加入博时上证80ETF基金基金经理,现任博时上证80ETF基金基金经理。 |

5 投资组合

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|----------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 2,436,240,900.16 | 64.38 |
| 2 | 固定收益 | 2,436,240,900.16 | 64.38 |
| 3 | 固定收益投资 | 921,975,265.30 | 24.37 |
| 4 | 其中:债券 | 921,975,265.30 | 24.37 |
| 5 | 资产支持证券 | - | - |
| 6 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 7 | 买入返售金融资产 | - | - |
| 8 | 其他金融资产 | 404,005,771.92 | 10.67 |
| 9 | 其他流动资产 | 21,705,556.28 | 0.57 |
| 10 | 合计 | 3,783,927,493.66 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分层的投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|---------|----------------|-------------|
| A | 农林、牧、渔业 | 298,647,358.40 | 8.27 |
| B | 采掘业 | 785,770,903.27 | 21.75 |
| C | 制造业 | 235,875,165.41 | 6.53 |
| D | 食品饮料 | - | - |
| E | 纺织服装、皮毛 | - | - |

5.3 主要财务指标

| 主要财务指标 | 报告期末2010年7月1日至2010年9月30日 |
|----------------|--------------------------|
| 1.本期已实现收益 | -180,974,563.53 |
| 2.本期利润 | 146,635,503.80 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0141 |
| 4.期末基金份额净值 | 1,901,144,465.62 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.200 |

5.4 基金管理人

| 姓名 | 职务 | 任本基金基金经理年限 | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------|------------|--------|--|
| 王克敏 | 基金经理 | 2010-1-5 | 11.5 | 1995年至1997年在哈工大从事物理学研究工作,1997年8月起先后在英商新加坡道明资产管理公司、美国新加坡道明资产管理公司、美国加纳巴拿马全球投资有限公司工作,2009年5月加入博时基金管理公司,现任ETF及量化投资部基金经理。 |

5.5 投资组合

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |

5.6 基金管理人

| 姓名 | 职务 | 任本基金基金经理年限 | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------|------------|--------|--|
| 王克敏 | 基金经理 | 2010-1-5 | 11.5 | 1995年至1997年在哈工大从事物理学研究工作,1997年8月起先后在英商新加坡道明资产管理公司、美国新加坡道明资产管理公司、美国加纳巴拿马全球投资有限公司工作,2009年5月加入博时基金管理公司,现任ETF及量化投资部基金经理。 |

5.7 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |

5.8 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |

5.9 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |

5.10 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |

5.11 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |

5.12 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |

5.13 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |

5.14 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,883,964,936.28 | 99.00 |

5.15 基金管理人

注:本基金合同于2009年12月20日生效,按照本基金的基金合同约定,自基金合同生效之日起3个月内使基金的资产组合比例符合本基金合同第十一条“资产配置范围”、“风险控制”的有关约定。本基金组合期末时点各项资产比例符合合同约定。

裕阳证券投资基金 2010 第三季度报告

2010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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2010年10月26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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年10月25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,保证复核数字不存在虚假记载、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2010年7月1日起至9月30日止。

2 基金产品概况

基金简称 博时招商转债
基金代码 500006
交易代码 500006
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日 1998年7月25日
报告期末基金份额总额 2,000,000,000份
投资目标 本基金的投资目的是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可转债实现基金的投资目标。
投资策略 本基金采取完全复制法,投资于可转债指数的成份股,跟踪该指数的表现,力求跟踪该指数的净值增长率,并力争超越该指数的净值增长率。本基金投资于可转债指数的成份股资产不低于基金资产净值的95%。
业绩比较基准 无
风险收益特征 本基金为跟踪指数的证券投资基金,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 主要财务指标和基金净值表现

| 主要财务指标 | 报告期末2010年7月1日至2010年9月30日 |
|----------------|--------------------------|
| 1.本期已实现收益 | 14,525,646.84 |
| 2.本期利润 | 309,597,277.77 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1548 |
| 4.期末基金份额净值 | 2.125,906,630.41 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0630 |

3.2 基金净值表现
与业绩比较基准业绩增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较
过去三个月 17.04% 2.29%

4 基金管理人

| 姓名 | 职务 | 任本基金基金经理年限 | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------|------------|--------|---|
| 谢力 | 基金经理 | 2005-2-4 | - | 1990年起先后在深圳市金信宇股份有限公司、深圳策略集团财务公司、上海证券培训中心工作,2000年加入博时公司,曾任研究员,现任博时可转债基金经理,博时策略基金经理。 |

5 投资组合

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,679,644,400.97 | 78.57 |
| 2 | 固定收益投资 | 427,457,500.00 | 20.00 |
| 3 | 其他金融资产 | 427,457,500.00 | 20.00 |

5.1 报告期末按行业分层的投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|---------|------------------|-------------|
| A | 农林、牧、渔业 | 605,132,239.94 | 31.83 |
| B | 采掘业 | 298,166,295.80 | 15.68 |
| C | 制造业 | 288,166,295.80 | 15.68 |
| D | 食品饮料 | - | - |
| E | 纺织服装、皮毛 | - | - |
| F | 医药、生物制品 | - | - |
| G | 信息技术业 | - | - |
| H | 批发和零售业 | - | - |
| I | 房地产业 | - | - |
| J | 社会服务业 | - | - |
| K | 传播与文化产业 | - | - |
| L | 综合类 | - | - |
| 合计 | 合计 | 1,883,964,166.28 | 99.10 |

5.2 报告期末按行业分层的投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|---------|------------------|-------------|
| A | 农林、牧、渔业 | 605,132,239.94 | 31.83 |
| B | 采掘业 | 298,166,295.80 | 15.68 |
| C | 制造业 | 288,166,295.80 | 15.68 |
| D | 食品饮料 | - | - |
| E | 纺织服装、皮毛 | - | - |
| F | 医药、生物制品 | - | - |
| G | 信息技术业 | - | - |
| H | 批发和零售业 | - | - |
| I | 房地产业 | - | - |
| J | 社会服务业 | - | - |
| K | 传播与文化产业 | - | - |
| L | 综合类 | - | - |
| 合计 | 合计 | 1,883,964,166.28 | 99.10 |

5.3 报告期末按行业分层的投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|---------|------------------|-------------|
| A | 农林、牧、渔业 | 605,132,239.94 | 31.83 |
| B | 采掘业 | 298,166,295.80 | 15.68 |
| C | 制造业 | 288,166,295.80 | 15.68 |
| D | 食品饮料 | - | - |
| E | 纺织服装、皮毛 | - | - |
| F | 医药、生物制品 | - | - |
| G | 信息技术业 | - | - |
| H | 批发和零售业 | - | - |
| I | 房地产业 | - | - |
| J | 社会服务业 | - | - |
| K | 传播与文化产业 | - | - |
| L | 综合类 | - | - |
| 合计 | 合计 | 1,883,964,166.28 | 99.10 |

5.4 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,679,644,400.97 | 78.57 |
| 2 | 固定收益投资 | 427,457,500.00 | 20.00 |

5.5 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,679,644,400.97 | 78.57 |
| 2 | 固定收益投资 | 427,457,500.00 | 20.00 |

5.6 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,679,644,400.97 | 78.57 |
| 2 | 固定收益投资 | 427,457,500.00 | 20.00 |

5.7 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,679,644,400.97 | 78.57 |
| 2 | 固定收益投资 | 427,457,500.00 | 20.00 |

5.8 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,679,644,400.97 | 78.57 |
| 2 | 固定收益投资 | 427,457,500.00 | 20.00 |

5.9 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,679,644,400.97 | 78.57 |
| 2 | 固定收益投资 | 427,457,500.00 | 20.00 |

5.10 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,679,644,400.97 | 78.57 |
| 2 | 固定收益投资 | 427,457,500.00 | 20.00 |

5.11 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,679,644,400.97 | 78.57 |
| 2 | 固定收益投资 | 427,457,500.00 | 20.00 |

5.12 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,679,644,400.97 | 78.57 |
| 2 | 固定收益投资 | 427,457,500.00 | 20.00 |

5.13 基金管理人

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|--------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 1,679,644,400.97 | 78.57 |
| 2 | 固定收益投资 | 427,457,500.00 | 20.00 |

5.14 基金管理人

注:本基金合同于2010年7月20日生效,按照本基金的基金合同约定,自基金合同生效之日起3个月内使基金的资产组合比例符合本基金合同第十一条“资产配置范围”、“风险控制”的有关约定。本基金组合期末时点各项资产比例符合合同约定。

上证超级大盘交易型开放式指数证券 2010 第三季度报告

2010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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2010年10月26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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年10月25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,保证复核数字不存在虚假记载、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2010年