(上接B22版)

(44)东兴证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人:崔海涛
联系人:黄英
电话:010-66555383
传真:010-66555393
客户服务电话:4008888993
网址:http://www.dxzq.net.cn
(45)东吴证券股份有限公司
注册地址:江苏省苏州市石路爱河桥28号
办公地址:江苏省苏州市石路爱河桥28号
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
客户服务电话:0512-96288
网址:http://www.dwjq.com.cn
(46)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
办公地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
电话:010-63080985
传真:010-63080978
客户服务电话:4008008899
网址:http://www.cindasc.com
(47)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人:王益民
联系人:吴宇
电话:021-63325888-3108
传真:021-63326173
客户服务电话:95503
网址:http://www.dfzq.com.cn
(48)方正证券股份有限公司
注册地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
办公地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
联系人:彭博
电话:0731-85832343
传真:0731-85832214
客户服务电话:95571
网址:http://www.foundersc.com
(49)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐浩明
联系人:刘晨
电话:021-22169081
传真:021-22169134
客户服务电话:4008888788;95525
网址:http://www.ebscn.com/
(50)广州证券有限责任公司
注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
办公地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
法定代表人:吴志明
联系人:林浩茹
电话:020-87322668
传真:020-87325036
客户服务电话:020-961303
网址:http://www.gzs.com.cn
(51)南京证券有限责任公司
注册地址:江苏省南京市玄武区大钟亭8号
办公地址:江苏省南京市玄武区大钟亭8号
法定代表人:张华东
联系人:徐翔
电话:025-83364032
传真:025-83320066
客户服务电话:4008285888
网址:http://www.njzq.com.cn
(52)大同证券经纪有限责任公司
注册地址:山西省大同市大北街13号
办公地址:太原市长治路111 号山西世贸中心A 座F12、F13
法定代表人:董祥
联系人:薛津
电话:0351-4130322
传真:0351-4192803
客户服务电话:4007121212
网址:http://www.dtsbc.com.cn
(53)国联证券股份有限公司
注册地址:无锡市县前东街168号
办公地址:无锡市县前东街168号国联大厦703室
法定代表人:范炎
联系人:徐欣
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
客户服务电话:4008885288(全国)、0510-82588168(无锡)
网址:http://www.glsc.com.cn
(54)浙商证券有限责任公司
注册地址:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
办公地址:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
法定代表人:吴承根
联系人:谢项辉
电话:0571-87901053
传真:0571-87901913
客户服务电话:0571-967777
网址:http://www.stocke.com.cn/
(55)平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇翔
联系人:周璐
电话:0755-22626172
传真:0755-82400862
客户服务电话:4008816168
网址:http://www.pingan.com/
(56)华安证券有限责任公司
注册地址:安徽省合肥市长江中路357号
办公地址:安徽省合肥市阜南路166号润安大厦
法定代表人:李工
联系人:甘霖
电话:0551-5161821
传真:0551-5161672
客户服务电话:0551-96518/4008096518
网址:http://www.hazq.com/
(57)东莞证券有限责任公司
注册地址:东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
办公地址:东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人:张运勇
联系人:梁健伟
电话:0769-22119341
传真:0769-22116999
客户服务电话:0769-961130
网址:http://www.dgzq.com.cn
(58)中原证券股份有限公司
注册地址:郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号中原广发金融大厦17层
法定代表人:石保上
联系人:程月艳 耿铭
电话:0371-65585670
传真:0371-65585665
客户服务电话:0371-967218;4008139666
网址:http://www.ccnew.com/
(59)中银国际证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:唐新宇
联系人:张静
电话:021-68604866-8309
传真:021-50372474
客户服务电话:4006208888;021-61195566
网址:http://www.bocichina.com
(60)恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人:刘汝军
联系人:张同亮
电话:0471-4913998
传真:0471-4930707
客户服务电话:0471-4961259
网址:http://www.cnht.com.cn/
(61)国盛证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市永叔路15号
办公地址:江西省南昌市北京西路88 号江信国际金融大厦
法定代表人:管荣升
联系人:徐美云
电话:0791-6285337
传真:0791-6289395
客户服务电话:0791-96168
网址:http://www.gsstock.com/
(62)华西证券有限责任公司
注册地址:四川省成都市陕西街239号
办公地址:四川省成都市陕西街239号
法定代表人:杨炯阳
联系人:金达勇
电话:0755-83025723
传真:0755-83025991
客户服务电话:4008888818
网址:http://www.hx168.com.cn
(63)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐建设路2号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:汤世生
联系人:李巍
电话:010-88085338
传真:010-88085240
客户服务电话:4008000562
网址:http://www.hysec.com
(64)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路20518号
办公地址:山东省济南市经七路86号23层
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0531-81283938
传真:0531-81283900
客户服务电话:95538
网址:http://www.qlzq.com.cn/
(65)世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人:卢长才
联系人:张婷
电话:0755-83199511
传真:0755-83199545
客户服务电话:0755-83199599
网址:http://www.csco.com.cn/
(66)华林证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
法定代表人:段文清
联系人:杨玲
电话:0755-82707888
传真:0755-82707850
客户服务电话:4008802888 或致电各地营业部客服电话
网址:http://www.chinalions.com/
(67)德邦证券有限责任公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人:方加春
联系人:罗芳
电话:021-68761616
传真:021-68767981
客户服务电话:4008888128
网址:http://www.tebon.com.cn
(68)广发华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8、10层
法定代表人:黄金琳
联系人:张腾
电话:0591-87278701
传真:0591-87841150
客户服务电话:96326(福建省外请加拨0591)
网址:http://www.gfhfzq.com.cn
(69)华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人:李晓安
联系人:李昕田
电话:0931-8888088
传真:0931-4890515
客户服务电话:0931-4890619 4890618 4890100
网址:http://www.hlzqgs.com/
(70)财通证券有限责任公司
注册地址:杭州市解放路111号
法定代表人:沈继宁
联系人:乔骏
电话:0571-87925129
传真:0571-87925100
客户服务电话:96336(上海地区962336)
网址:http://www.ctsec.com
(71)中国建银投资证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至20层
办公地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至20层
法定代表人:杨明辉
联系人:杨瑞芳
电话:0755-82026511
传真:0755-82026539
客户服务电话:4006008008
网址:http://www.cjis.cn/
(72)中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人:吴泳良
联系人:李珍
电话:0755-82943755
传真:0755-82940511
客户服务电话:0755-82943750
网址:http://www.zszq.com.cn
(73)日信证券有限责任公司
注册地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层
法定代表人:孔佑杰
联系人:陈韦杉
电话:010-88086830
传真:010-66412537
客户服务电话:010-66413306
网址:http://www.rxzq.com.cn
(74)江海证券有限公司
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
联系人:张宇宏
电话:0451-82336863
传真:0451-82287211
客户服务电话:4006662288
网址:http://www.jhzq.com.cn
(75)天源证券经纪有限公司
注册地址:青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼
办公地址:深圳市民田路新华保险大厦18楼
法定代表人:裴东平
联系人:关健
电话:0755-33331188
传真:0755-33329815
客户服务电话:4006543218
网址:http://www.tyzq.com.cn
(76)华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层
法定代表人:陈林
联系人:徐方亮
电话:021-50122222
传真:021-50122200
客户服务电话:4008209898;021-38929908
网址:http://www.cnhbstock.com
(77)厦门证券有限公司
注册地址:厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼
办公地址:厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼
法定代表人:傅毅辉
联系人:卢金文
电话:0592-5161816
传真:0592-5161102
客户服务电话:0592-5163588
网址:http://www.xmzq.cn
(78)爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市南京西路758号23楼
办公地址:上海市南京西路758号20-25楼
法定代表人:郭林
联系人:陈敏
电话:021-32229888
传真:021-62878783
客户服务电话:021-63340678
网址:http://www.ajzq.com
(79)大通证券股份有限公司
注册地址:辽宁省大连市中山区人民路24号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层
法定代表人:于宏民
联系人:谢立军
电话:0411-39673202
传真:0411-39673219
客户服务电话:4008169169
网址:http://www.daton.com.cn
二、注册登记机构
名称:博时基金管理有限公司
住所:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层
办公地址:北京建国门内大街18号恒基中心1座23层
法定代表人:杨鹤
电话:(010)65171166-2189
传真:(010)65187068
联系人:王健
三、律师事务所和经办律师
名称:国浩律师集团(北京)事务所
注册地址:北京市朝阳区东三环北路38号泰康金融大厦9层
办公地址:北京市朝阳区东三环北路38号泰康金融大厦9层
电话:010-65890699
传真:010-65176800
联系人:黄伟民
经办律师:黄伟民、陈周
四、会计师事务所和经办注册会计师
机构名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址:上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
法人代表:杨绍信
电话:021-61238888
传真:021-61238800
经办注册会计师:汪棣、张鸿
16.对招募说明书更新部分的说明
本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金管理人于2010年6月11日刊登的本基金原招募说明书(《博时大中华亚太精选股票证券投资基金招募说明书》)进行了更新,主要更新的内容如下:
1、在4.“基金的投资”中,更新了本基金截止时间为2010年12月31日的基金股票及其它资产投资组合的数据及列表;
2、在5.“基金的业绩”中,该部分内容均按有关规定编制,并经托管人复核;
3、在6.“基金管理人”中,对本公司股东、部门设置、人员结构及投资决策委员会成员进行了更新;
4、在7.“基金的募集与基金合同的生效”中,更新了基金合同生效的内容;
5、在8.“基金份额的申购、赎回与转换”中,更新了定期定额投资业务;
6、在9.“基金费用与税收”中,更新了本基金销售费用的相关内容;
7、在16.“基金托管人”中,对基金托管人的基本情况、主要人员情况及相关业务经营情况进行了更新;
8、在17.“境外托管人”中,对境外托管人的基本情况、主要人员情况及相关业务经营情况进行了更新;
9、在18.“投资顾问”中,对投资顾问的基本情况、主要人员情况及相关业务经营情况进行了更新;
10、在19.“相关服务机构”中,更新了相关服务机构的内容,增加了新增的代销机构;
11、在23.“其它应披露的事项”中,根据最新情况对相关应披露事项进行了更新。

博时基金管理有限公司
2011年3月12日

(上接B21版)

(2)不同年期债券的配置策略
本基金对不同年期债券的配置,主要采取期限结构策略。通过预测收益率曲线的形状和变化趋势,对各类不同年期的债券进行久期配置,力争组合收益超过业绩比较基准收益。具体来看,包括跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。本基金主要通过以下方法来确定不同年期的债券配置比例:
方法一:博时收益率领先指标模型。
该方法主要通过将影响债券收益率的指标进行定量化处理,结合我国的宏观经济监测指标体系以及债券市场自身的特性,本基金选取制造业新订单、股票指数、M2等指标作为编制收益率领先指数的指标库,计算出一个债券收益率的领先指数。从历史检验结果看,该指数的波动领先于无风险利率的波动,通过计算该领先指数的运行趋势,能够预测利率产品的整体走势。
方法二:宏观经济指标评价体系。
该评价体系的理念:通过预测宏观经济指标未来的趋势,并与现在进行比较,得出债券收益率在现在基础上的运行趋势。本基金将考察的时间分为短期与中长期,确定每个宏观经济指标的评分范围,依据这些指标与收益率的关系进行评分,计算出收益率在未来短期与中长期的趋势与压力。本基金再根据中长期趋势与短期趋势得分的差异进行不同期限的债券配置。
方法三:收益率曲线预测模型。
该模型由两部分组成,第一部分为远期的即期利率预测,第二部分为未来考察期限内的即期利率运行趋势预测。将这两部分结合就能构建考察期限内、相应时点的收益率曲线。本基金将这些预测的收益率曲线与当前收益率曲线进行比较,为当前投资不同期限的债券投资提供支持。
2.本基金固定收益类资产的主要投资策略
本基金固定收益类资产(由于投资对象和投资方法的特殊性,不含可转债)的主要投资策略如下:
在以上大类资产以及不同年期固定收益类资产的比例确定的基础上,本基金主要采取通过抽样复制技术模拟中证分年期债券系列指数的走势;同时,灵活应用期限结构策略、信用策略、互换策略以及息差策略等,在合理管理并控制组合风险的前提下,最大化组合收益。
①通过抽样复制模拟分年期债券指数走势
债券市场的交易习惯与股票市场有很大差异,在复制债券市场指数时,本基金将采用抽样复制的方法,综合考虑指数中样本的发行规模、流动性、代表性及抽样组合与对应指数的相关性选择成份债券。
分层抽样法将标的指数所有成分证券按某种标准分为若干层,每一层为总体中的一个子集,各子集所包含的个体互不重叠,且至少拥有一种共同的特性。然后,再按一定的抽样方式在各层中抽出若干样本,各层抽出的样本,统一组成一个足够多的总样本。
能否找到合适的标准对标的指数全部成分证券进行分层,使得各层的样本至少有一个与其他各层不同的属性,是分层抽样法的一个关键。分层抽样的标准或方法可以有多种,对于国内债券市场,本基金将以指数样本券的剩余年限和信用级别作为一个二维分类标准,即将剩余年限与信用级别作为两个坐标轴,根据坐标轴的数值,将指数成份证券划分到坐标系的不同区域中,按每个区域所含证券总数或总权数分配各区域抽样比例。在每一个区域内,本基金将通过评分的方法对样本进行抽样,评分指标体系包括:债券久期、债券收益率、债券发行规模、债券流动性、债券发行人属性等因素。
②适当的主动投资
本基金的固定收益类资产主要采取分层抽样的方法模拟相应年期的债券指数,在个券投资上,主要运用信用策略、互换策略和息差策略,进行适当的主动投资,以增强收益。
1)信用策略
信用利差收益率主要受两个方面的影响,一是债券对应信用水平的市场信用利差曲线走势;二是债券本身的信用变化。本基金依靠内部评级系统分析债券的相对信用水平、违约风险及理论信用利差,分析信用利差曲线整体及分行业走势,确定各类债券投资比例。
2)互换策略
不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面存在差别,投资管理人可以同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种,赚取收益率差。
3)息差策略
通过正回购,融资买入收益率高于回购成本的债券,从而获得杠杆放大收益。
3、可转债投资策略
本基金采取参考天相可转债指数的方法进行可转债投资。由于可转换债券兼具债性和股性特征,本基金将在参考天相可转债指数的基础上,采用自上而下的宏观、行业分析和自下而上的转债转性分析相结合的方法投资可转债。
4.权益类品种投资策略
①一级市场申购策略
本基金权益类品种申购决策主要考虑一、二级市场溢价率、中签率和申购机会成本三个方面。一级市场申购策略的关键是选取合适的定价模型和参数,在定价过程中充分考虑对应市场的平均估值水平和近期发行的证券的估值水平,以契合当期的投资环境。
②二级市场股票投资策略
本基金的股票类资产作为整体基金投资组合管理的辅助工具,为投资者提供适度参与股票市场、获取市场收益的机会。
本基金的股票投资将主要遵循三个步骤:一是重点关注我们研究团队长期跟踪并具有良好业绩记录的公司,并将此类公司作为本基金的基本股票池,同时关注不同时期的主题;二是对股票的基本面素质进行筛选。应用基本面分析方法,确定其实际的估值水平,筛选出投资股票池名单;三是通过预设指令的方法,在市场的相应时机以我们认同的具备一定安全边际的价格,对个股予以动态配置,追求在可控风险前提下的稳健回报。
5.投资决策流程
投资决策委员会是本基金的最高决策机构,定期或遇重大事件时就投资管理业务的重大问题进行讨论,并对本基金投资做方向性指导。基金经理、研究员、交易员等各司其责,相互制衡。具体的投资流程为:
①投资决策委员会定期召开会议,确定本基金的总投资思路和投资原则。
②研究部宏观策略分析师基于自上而下的研究为本基金提供总的资产配置建议;研究部行业研究员为信用债的信用分析提供研究支持;固定收益部数量及信用分析员为固定收益类投资决策提供依据。
③固定收益部、股票投资部定期召开投资例会,根据投资决策委员会的决定,结合市场、个股和个券的变化,制定具体的投资策略。
④基金经理依据投委会的决定,参考研究员的投资建议,结合风险控制和业绩评估的反馈意见,根据市场情况,制定并实施具体的投资组合方案。
⑤基金经理向交易员下达指令,交易员执行后向基金经理反馈。
⑥监察法律部对投资的全过程进行合规风险监控。
⑦风险管理部通过行使风险管理职能,测算、分析和监控投资风险,根据风险限额管理政策防范超预期风险。
⑧风险管理部对基金投资进行风险调整业绩评估,定期与基金经理讨论收益和风险预算。

第九部分 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率
中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,对异常价格和无价情况下使用了模型价,能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。由于本基金为债券型基金,在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法以及指数与本基金投资范围、投资理念的吻合度后,本基金选择市场认同度较高的中证全债指数收益率作为业绩比较基准。
如果今后市场出现更具代表性的业绩比较基准,或者指数编制单位停止编制该指数,或有更具权威、更科学的复合指数权重比例,在与基金托管人协商一致后,本基金管理人可以在报中国证监会备案后调整或变更业绩比较基准并及时公告。

第十部分 风险收益特征

本基金为债券型基金,预期收益和风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于中低风险收益的产品。

第十一部分 基金投资组合报告

博时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。
基金托管人根据本基金合同规定,复核了本报告中的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。
本投资组合报告所载数据截至2010年12月31日,本报告中所列财务数据未经审计。
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	94,998,840.38	11.00
	其中:股票	94,998,840.38	11.00
2	固定收益投资	696,059,989.80	80.60
	其中:债券	696,059,989.80	80.60
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	17,603,567.44	2.04
6	其他各项资产	54,905,022.43	6.36
7	合计	863,567,420.05	100.00

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	1,877,586.30	0.24
B	采掘业	12,857,700.30	1.67
C	制造业	61,678,279.88	8.01
C0	食品、饮料	2,138,805.68	0.28
C1	纺织、服装、皮毛	1,676,801.30	0.22
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,484,000.00	0.32
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	15,723,348.65	2.04
C7	机械、设备、仪表	39,655,324.25	5.15
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	110,522.00	0.01
E	建筑业	2,165,037.00	0.28
F	交通运输、仓储业	3,009,956.00	0.39
G	信息技术业	1,021,315.00	0.13
H	批发和零售贸易	2,472,489.80	0.32
I	金融、保险业	5,514,226.10	0.72
J	房地产业	4,291,728.00	0.56
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	94,998,840.38	12.34

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	002531	天顺风能	1,150,000	29,118,000.00	3.78
2	601958	金钼股份	349,919	8,482,036.56	1.10
3	601890	亚星锚链	233,907	5,029,000.50	0.65
4	000878	云南铜业	150,000	4,125,000.00	0.54
5	000960	锡业股份	125,000	4,087,500.00	0.53
6	600549	厦门钨业	79,994	3,806,914.46	0.49
7	000983	西山煤电	124,446	3,321,463.74	0.43
8	600048	保利地产	251,460	3,193,542.00	0.41
9	601177	杭齿前进	162,825	2,610,084.75	0.34
10	000792	盐湖钾肥	37,500	2,484,000.00	0.32

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	国家债券	8,112,616.00	1.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	267,262,000.00	34.71
	其中:政策性金融债	267,262,000.00	34.71
4	企业债券	159,421,052.40	20.70
5	企业短期融资券	149,939,000.00	19.47
6	可转债	111,325,321.40	14.46
7	其他	-	-
8	合计	696,059,989.80	90.39

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	749,720	88,571,920.80	11.50
2	100401	10农发01	800,000	79,392,000.00	10.31
3	100301	10进出01	700,000	68,614,000.00	8.91
4	122033	09富力债	550,000	57,585,000.00	7.48
5	122020	09复地债	500,000	52,395,000.00	6.80

6、本基金本报告期未持有资产支持证券。
7、本基金本报告期未未持有权证。
8、投资组合报告附注
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。
②基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
③基金的其他资产包括:

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	12,019,614.41
3	应收股利	-
4	应收利息	11,591,119.04
5	应收申购款	31,044,288.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,905,022.43

④报告期末持有处于转股期的可转换债券。
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
⑤报告期末前十名股票中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)	占基金资产的净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002531	天顺风能	29,118,000.00	3.78	新股冻结
2	601890	亚星锚链	5,029,000.50	0.65	新股冻结
3	601177	杭齿前进	2,610,084.75	0.34	新股冻结

⑥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。

第十二部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
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:
1、博时宏观回报债券A/B类:

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
2010年10月1日-2010年12月31日	-1.00%	0.41%	-2.26%	0.14%	1.26%	0.27%
2010年7月27日-2010年12月31日	-0.6%	0.31%	-1.64%	0.11%	1.04%	0.20%

2、博时宏观回报债券C类:

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
2010年10月1日-2010年12月31日	-1.10%	0.42%	-2.26%	0.14%	1.16%	0.28%
2010年7月27日-2010年12月31日	-0.8%	0.32%	-1.64%	0.11%	0.84%	0.21%

第十三部分 基金费用与税收

一、与基金运作有关的费用
(一)基金费用的种类
1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、销售服务费:本基金从C类基金份额的基金资产中计提销售服务费;
4、因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);
5、基金合同生效以后的信息披露费用;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金合同生效以后的会计师费和律师费;
8、基金资产的资金汇划费用;
9、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。
(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1、基金管理人的管理费
基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.70%年费率计提。
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.70%÷当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。
2、基金托管人的基金托管费
基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.20%年费率计提。
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%÷当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。
3、销售服务费
本基金A类/B类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.35%。
本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.35%年费率计提。
计算方法如下:
H=E×0.35%÷当年天数
H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E 为C类基金份额前一日基金资产净值
销售服务费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。
销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。
4、本条第一款第4至第9项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。
二、与基金销售有关的费用
1、申购费用

表:本基金的申购费率结构

A类基金份额	
申购金额M	前端申购费率
M<100万元	0.80%
100万元≤M<300万元	0.50%
300万元≤M<500万元	0.30%
500万元≤M	按笔收取,1000元/笔
B类基金份额	
持有年限Y	后端申购费率
Y<1年	1.00%
1年≤Y<2年	0.70%
2年≤Y<3年	0.30%
3年≤Y	0%
B类基金份额	
申购费率	0%

注:1年指365天。
2、赎回费用
表:本基金的赎回费率结构

A类/B类基金份额	
持有年限Y	赎回费率
Y<1年	0.10%
1年≤Y<3年	0.05%
3年≤Y	0%
C类基金份额	
赎回费率	持有期限少于30日的基金份额,赎回费率为0.75%;持有期限不少于30日(含30日)的基金份额,不收取赎回费用。

注:1年指365天。
3、转换费用
基金转换费用由转出基金赎回费和申购费补差两部分构成,其中:申购费补差具体收取情况,视每次转换时的两只基金的申购费率的差异情况而定。基金转换费用由基金持有人承担。
基金管理人可根据有关法律规定和市场情况,调整申购金额、赎回份额和账户最低持有余额的数量限制,基金管理人必须最迟在调整前2日在至少一种指定媒体上公告。
三、不列入基金费用的项目
本条第一款约定以外的其他费用,以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失不列入基金费用。
四、基金管理费和基金托管费的调整
基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。
五、税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金管理人于2010年6月18日刊登的本基金原招募说明书(《博时宏观回报债券型证券投资基金招募说明书》)进行了更新,主要更新的内容如下:
1.在“三、基金管理人”中,对本公司股东、部门设置、人员结构及投资决策委员会成员进行了更新;
2.在“四、基金托管人”中,对基金托管人的基本情况、主要人员情况及相关业务经营情况进行了更新;
3.在“五、相关服务机构”中,更新了相关服务机构的内容;增加了新增的代销机构;
4.在“六、基金份额的发售”中,更新了基金合同生效的内容;
5.在“八、基金份额的申购、赎回与转换”中,更新了转换业务适用基金的范围,更新了业务办理时间;
6.在“九、基金的投资”中,更新了本基金截止时间为2010年12月31日的基金股票及其它资产投资组合的数据及列表;
7.在“十三、基金费用与税收”中,更新了本基金销售费用的相关内容;
8.在“二十一、其它应披露的事项”中,根据最新情况对相关应披露事项进行了更新。

博时基金管理有限公司
2011年3月12日

证券代码:鲁西化工　证券简称:000830　公告编号:2011-006

鲁西化工集团股份有限公司澄清公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、传闻情况
近日有关媒体报导了涉及鲁西化工集团股份有限公司(以下简称鲁西化工或公司)下属子公司平阴鲁西化工第三化肥有限公司环境污染泄漏事故的报道。
2011年3月11日由《上海证券报》报导了《鲁西化工隐瞒污染事故120天骗取增发》的文章。文中主要提及:
传闻①:2010年10月29日,第三化肥厂在未向该县环保局报告的情况下擅自对1号75吨锅炉炉后脱硫设施进行检修,脱硫设施在检修过程中,脱硫液经脱硫液渠流入1000立方米的应急池中,该渠道与公司内的雨水渠交叉,由于大型机械车辆长期碾压导致脱硫液渠与雨水渠交叉处的隔断损毁,致使部分脱硫液由雨水渠流入公司内泄洪渠,经污水收集管网进入县污水处理厂,造成了污水处理厂进水氨氮浓度偏高。
传闻②:第三化肥厂曾在2005年就发生过尿素合成塔爆炸事故,造成4人死亡多人受伤的严重后果。
传闻③:第三化肥厂泄漏事故已经过去一段时间,环保局早处理完毕,相应的罚款去年也已经处罚完毕,厂长也已经被撤换了。平阴县环保局工作人员的表态也证实了本次污染事故的严重性。
传闻④:第三化肥厂现在已不做化工业务,转行为机械加工。
二、澄清说明
公司针对上述传闻组织相关人员进行了认真调查研究、核实,事项说明如下:
传闻①反映的该事件过程基本属实,但经环保局认定该事件未对厂区周边环境造成影响。环保局在查处该事件的过程中发现该厂未经其批