

# 博时现金收益证券投资基金

2012 第三季度 报告	2012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:交通银行股份有限公司  
报告送出日期:2012年10月25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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月24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2012年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况	
基金名称	博时现金收益货币
基金代码	050003
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7月6日
报告期末基金份额总额	39,078,391,348.85份
投资目标	在保证风险和流动性前提下,谋求高于业绩基准的回报。
投资策略	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配置。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)
风险收益特征	现金收益证券投资基金属于短期货币市场基金工具,由于这些金融工具的特点,因此本基金面临的风险程度相对较低。但是,本基金仍投资于各种期限的债券资产,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。
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

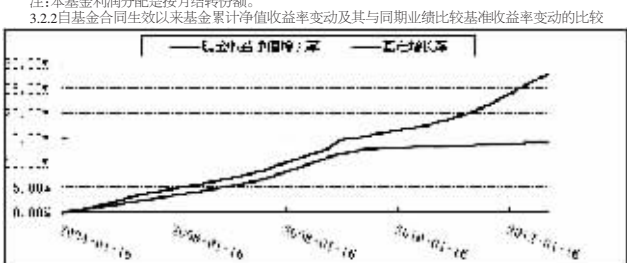
3.1主要财务指标		单位:人民币元
主要财务指标	报告期 2012年7月1日~2012年9月30日	
1.本期已实现收益		390,431,410.52
2.本期利润		390,431,410.52
3.期末基金资产净值		39,078,391,348.85
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。		

3.2.1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	净值增长率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	0.0041%	0.0015%	0.0090%	0.0000%	0.8140%	0.0015%

注:本基金利润分配是按月结转份额。

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



注: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、(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符合基金合同约定。

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 (任职日期 离任日期)	证券从业年限	说明
张勇	固定收益部副经理兼现金基金经理	2006-7-1 -	9	2001年起先后在南京市商业银行总行总行,南京市商业银行银行资产管理部,工作。2003年加入大成基金管理有限公司,历任债券交易员、现金基金经理、固定收益部副经理兼现金基金经理、现任大成基金固定收益部副经理兼现金基金经理,曾同时兼任现金基金经理兼固定收益部基金经理。
<b>4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况说明</b> 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、《博时现金收益证券投资基金基金合同》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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,由于证券市场波动等原因,本基金曾出现投资偏离指标不符合基金合同约定的情况,基金管理人规定期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。				
<b>4.3 公平交易专项说明</b> <b>4.3.1 公平交易制度的执行情况</b> 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。				

§5投资组合报告	
序号	项目
1	固定收益投资
1.1	固定收益投资
2	资产支持证券
2.1	买入返售金融资产
3	银行存款和结算备付金合计
4	其他各项资产
5	合计
5.2	报告期内债券回购融资情况

5.1 报告期内基金资产组合情况		\$5投资组合报告	
序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	13,767,422,544.32	35.20
	其中：债券	13,767,422,544.32	35.20
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,863,373,995.06	4.76
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	22,896,194,734.46	58.54
4	其他各项资产	585,069,262.20	1.50
5	合计	39,112,060,536.04	100.00
5.2 报告期内债券回购融资情况			
序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	-	3.42
	其中：买断式回购融资	-	-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报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

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:2012年10月25日	
<b>§1重要提示</b>	
基金管理人、基金托管人及基金销售机构本报告所载资料均来源于国家统计、证券交易所公开披露或其他合法公开渠道,对本报告内容的真实性、准确性和完整性不作任何保证。本报告内容不构成对任何证券、商品或服务的投资建议,也不构成对任何证券、商品或服务的价格判断。	
基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2012年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资运作指标等内容,保证基金管理人对上述内容的真实、准确和完整负责,但不对其来源的可靠性负责。	
本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,也不保证基金份额持有人一定本金不受损失。	
基金的过往业绩并不代表其未来业绩表现。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。	
本报告自2012年7月1日起至9月30日止。	

基金简称	博时新兴成长股票
基金代码	050009
交易代码	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	19,573,779,700.42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和积极投资资本市场各类行业中的新兴高速成长企业,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	法,在股票、债券和其他资产等大类之间进行配置。本基金资产分析和预测涵盖众多宏观经济因素,如GDP增长率、CPI、PPI、M2的增长对水平和增长率、利率水平、利率走势、货币供应量、财政政策、货币市场以及股市政策变化等因素,并在此基础上,确定资产配置。本基金资产在此基础上确定投资,即确定投资资产和现金等大类资产在投资组合中的权重分布。
业绩比较基准	中证300指数收益率×90%+中国债券总指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于中长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

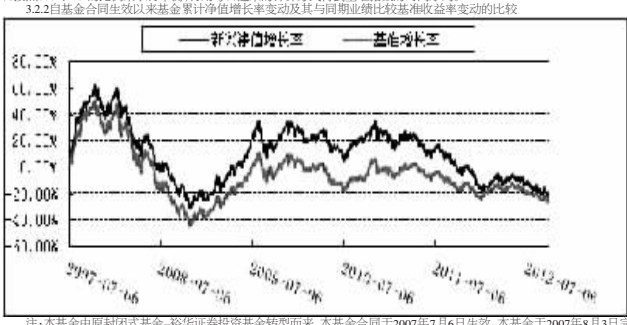
§3 主要财务指标和基金净值表现	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期 2012年7月1日-2012年9月30日
1.本期已实现收益	-218,717,085.25
2.本期利润	-899,099,262.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0457
4.期末基金资产净值	9,727,513,177.59
5.期末基金份额净值	0.497

注: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。

上述基金净值增长不包括与交易基金的各项费用,计入费用后投资者的实际收益水平要低于所列数字。						
3.2基金业绩表现						
3.2.1 报告期内基金的净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的对比						
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③	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.47%	1.24%	-5.52%	0.95%	-2.95%	0.29%

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

由于基金资产仓位比例在不同变动变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的仓位比例符合基金合同要求,基准指数(指



注:本基金由原封闭式基金-博时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31日转

比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内,本基金市场债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3.1基金投资组合平均剩余期限

5.3.2报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

§2基金产品概况	
基金名称	博时卓越品牌股票(LOF)
场内简称	博时卓越
基金代码	160512
交易代码	160512
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2011年4月22日
报告期末基金份额总额	301,897,442.32份
投资目标	本基金主要通过投资于A股市场经过严格筛选的具有投资价值的品牌上市公司股票,力争通过主动操作,获取较长期限内的资本增值和资本利得。
投资策略	在大类资产配置上,本基金通过自上而下的宏观分析与自下而上的行业、公司分析和估值分析有机结合起来进行前瞻性的决策。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+中证全指指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期收益及风险水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金,属于高风险收益特征的股票型基金。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

5.4 报告期末按券种品种分类的债券投资组合			
序号	债券品种	摊余成本 (元)	占基金资产净值的比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	796,754,950.18	2.04
3	金融债券	1,622,368,276.74	4.15
	其中:政策性金融债	1,622,368,276.74	4.15
4	企业债券	254,092,367.46	0.65
5	企业短期融资券	11,094,206.9494	28.39
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	13,767,422,544.32	35.23
9	剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	254,092,367.46	0.65

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	041215015	12国债01	20,000	2,001,342,843.63	3.12
2	1101085	11央行债088	7,000,000	696,995,157.23	1.28
3	1202228	12国债27	5,000,000	499,729,620.00	0.78
4	1202218	12国债26	3,400,000	341,273,177.50	0.57
5	120305	12国债05	3,000,000	300,176,262.65	0.87
6	120405	12国债05	2,500,000	250,225,452.94	0.64
7	011307001	13国债07	2,000,000	240,000,000.00	0.52
8	0900147	09央行05	2,000,000	204,335,506.18	0.52
9	041256009	12国债09	2,000,000	201,253,275.75	0.51
10	110120701	12国债07	2,000,000	200,000,040.07	0.51

§5投资组合报告	
序号	项目
1	固定收益投资
1.1	固定收益投资
2	资产支持证券
2.1	买入返售金融资产
3	银行存款和结算备付金合计
4	其他各项资产
5	合计
5.2	报告期内债券回购融资情况

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。

5.8.投资组合报告附注

5.8.1.基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金份额净值始终保持为1.00元。

5.8.2.报告期内本基金投资的前十名证券中,有3项为剩余存续期超过397天的浮动利率的资产支持证券,其成本超过基金资产净值20%的情况。

5.8.3.报告期内本基金基金资产的前十名证券的发行主体没有接受监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.4.其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	有价证券	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	574,447.62662
4	应收申购款	10,526.63558
5	其他应收款	95,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	585,069.26220

5.8.5.投资组合报告附注的其他文字描述部分

\$6开放式基金份额变动		单位:份
本报告期期初基金份额总额		29,903,272,520.33
本报告期基金总申购份额		57,253,857,241.88
减:本报告期基金总赎回份额		48,078,198,413.36
本报告期基金份额变动		30,078,931,348.85

§8 博时基金管理人的其他重要信息	
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“国家创造财富”是博时的使命,博时的投资理念是“投资价值的发现者”。截至2012年9月30日,博时基金管理公司共管理22只开放式基金,使用现金和国债以及封闭式基金,并享有全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金,以及多个全国社保基金组合。公募基金资产规模1230亿元人民币,累计合计574.23亿元人民币,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业内名列前茅。	
1. 基金简称	
根据银河证券基金研究中心统计,截至2012年9月28日,开放式基金、股票型基金中,博时创业成长基金、博时第三产业股票型证券投资基金274只排名第3和排名第3;指数型基金中,博时上证80ETF及上证50ETF联接基金在同类162只基金中分别排名第3和第4;封闭式基金中,基金鑫隆在同类25只基金中排名第3。	

2.客户服务	
2012年三季度,博时基金共举办各类渠道培训活动共计逾194场;博时e视界”共举办视频直播活动10场,在线人数累计417人次;	
3.其他大事件	
1.博时医疗保健行业基金首募顺利结束并于8月28日正式成立。	
2.博时信用债纯债基金首募顺利结束并于9月7日正式成立。	
§8备查文件目录	
8.1备查文件目录	

8.1.1	中国证监会批准博时现金收益证券投资基金设立的文件
8.1.2	《博时现金收益证券投资基金基金合同》
8.1.3	《博时现金收益证券投资基金托管协议》
8.1.4	基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
8.1.5	博时现金收益证券投资基金年度和半年度报告
8.1.6	报告期内博时现金收益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

博时一统编号:951035508 (仅用于送货)

博时基金管理有限公司  
2012年10月25日

博时新兴成长股票