

2012 第一季度报

3	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,070,673.16	0.68
8	其他资产	15,801,786.14	2.63
9	合计	600,067,697.96	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农林牧渔	-	-
B 采掘业	-	-
C 制造业	3,947,895.00	0.78

C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,380,000.00	0.27
C5	电子	9,750.00	0.00
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	2,558,145.00	0.51
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	-	-
E	建筑业	2,723,613.50	0.54
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	21,130.00	0.00
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险	2,502,500.00	0.50
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	43,950.00	0.01
M	综合类	-	-
	合计	9,720,098.50	1.82

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	002620	瑞和股份	125,470	2,703,878.50	0.54
2	000651	格力电器	124,000	2,520,920.00	0.50
3	601555	东旭光电	350,000	1,502,500.00	0.30
4	002488	卫光生物	300,000	1,380,000.00	0.27
5	000929	吉视传媒	5,000	43,950.00	0.01
6	300306	远方光电	500	21,575.00	0.00
7	002663	普邦园林	500	19,735.00	0.00
8	300307	惠思股份	500	15,650.00	0.00
9	300302	同有科技	500	11,400.00	0.00
10	300310	北方华创	500	10,350.00	0.00

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	26,187,369.40	5.18
2	央行票据	-	-
3	金融债	-	-
4	其中,政策性金融债	-	-
5	企业债券	515,251,155.06	101.96
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	可转债	29,517,625.70	5.84
9	其他	-	-
10	合计	570,956,150.16	112.98

5.3 报告期期末公允价值计量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)
1	122888	12年国开01	100,000	51,080,000.00
2	120052	12年国债02	500,000	50,285,000.00
3	1208054	12年国债05	500,000	50,243,000.00
4	1181006	11年国债06	500,000	50,075,000.00
5	1181008	11年国债08	480,000	48,270,000.00

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	2,514,630.01
3	应收股利	-
4	应收利息	13,188,097.55
5	应收申购款	99,058.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,801,786.14

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	14,637,021.30	2.90
2	110015	石化转债	13,140,400.00	2.60
3	125731	美丰转债	917,254.80	0.18
4	125089	深润转债	822,949.60	0.16

本基金本报告期末未持有的工行转债(113002)于报告期内,转股期为2011-01-01至2016-08-31,公允价值按本报告期末的公允价值14,637,021.30元计量,转股日为2011-06-24至2017-02-02,31。本基金本报告期末未持有的美丰转债(125731)于报告期内,转股期为2010-12-02至2015-06-02。5.8.5 报告期内,前十名股票公允价值存在显著波动的公允价值变动损益为2012-01-01至2017-07-14。

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

5.8.6 投资组合报告期末的其他资产描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

96 开放式基金投资变动

单位:份

报告期间基金份额总额	303,033,501.73	256,472,527.03
报告期间基金份额持有人户数	16,720,131.27	5,361,173.76
减:报告期间基金份额赎回总额	38,050,671.18	33,063,289.66
报告期间基金份额变动份额(份额减少以“-”填列)		
报告期末基金份额总额	281,702,961.82	228,670,411.13

57 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.1 本基金设立等相关批准文件

1.2 长城积极增长利率型证券投资基金基金合同

1.3 长城积极增长利率型证券投资基金托管协议

1.4 法律意见书

7.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照

7.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照

7.2 中国证监会规定的其它文件

7.2 有效地址

广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

7.3 联系方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅,如有疑问,可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询:

咨询电话:0755-23982338

客户服务电话:400-8868-666

网站: www.ccfund.com.cn

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	4,925,226.55
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,522,630.54
6	其他应收款	151,801.07
7	待摊费用	-

9	其他		-	
10	合计		20,849,658.16	
5.8.4 报告期末持有处于转股期的可转换债券明细				
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产的净值比例(%)
1	113002	工行转债	738,745,698.60	28.42
2	113001	中行转债	716,359,782.40	27.56
3	110013	国铁转债	160,816,487.20	6.17
4	110018	国电转债	147,384,904.40	5.69
5	110015	石化转债	95,780,375.60	3.69
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。				
本基金本报告期末前十名债券中不存在流通受限情况。				

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。

	单位：份	
项目	本期转申购基金份额A类	本期转申购基金份额C类
本报告期初初基金份额总额	1,581,872,574.14	1,121,570,279.38
本报告期基金总申购份额	371,373,349.95	19,656,647.15
减：本报告期基金总赎回份额	126,413,270.04	69,935,036.90
本报告期基金份额变动净额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,826,832,654.05	1,071,291,889.63

6、影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的基金管理公司之一，为“中国创造财富”理念的使者。博时的投资理念是：“投资价值的发现者”。截至2015年3月31日，博时基金总资产达一千七百九十九亿元人民币。

1. 担任基金基金经理,并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金,与多个企业年金基金,资产管理规模达187.67亿元人民币;累计管理3565.87亿元人民币,是目前国内资产管理规模最大的基金公司之一,亦是国内基金行业排名中名列前茅。

2. 基金业绩

根据Wind资讯统计截至2013年3月31日,博时平衡配置混合基金在同类型14只基金中排名第1。

3. 客户服务

2012年1月至3月,博时基金共举办各类渠道培训活动达65场;“博时·视界”共举办视频直播活动12场,在人数较少的1062人次;1月5日至7月,2012博时中国机构投资者闭门精英之夜,到会嘉宾逾千人。1月6日中午在博时基金总部举办2012博时中国机构投资者闭门精英之夜,到会嘉宾逾千人,通过此次活动,博时与客户充分沟通了当前市场热点话题,受到了投资者的广泛欢迎。

3. 品牌荣誉

2012年11月,在“壹财经”举办的2012年度中国基金明星颁奖礼上,我司共获得7项大奖;博时基金品牌曾获得2011年度十大明星基金品牌奖,博时货币基金品牌荣获“三年持续回报型股票基金”奖,博时主题

“转型金融基金”和“碳中和”主题基金共获得 2019 年度股票型主题基金金奖、可转债主题基金金奖和可转债价值基金金奖。2019 年度“碳中和”主题基金金奖：博时碳中和股票获得 2019 年度碳中和基金金奖。

2021 年 6 月 26 日，在“星图 2021 年度中国基金业年度评选”中，我国旗下前十大产品获得提名，其中主题行业股票型基金获得“星图 2021 年度股票型基金”提名，其中价值增长九号组合获得“星图 2021 年度混合型基金”提名。

2021 年 8 月 28 日，中债基金 2021 年基金法法暨第九届中债基金行业颁奖典礼在沪举行。博时基金荣获六项大奖：2021 年度中国债券基金年度优秀策略基金、2021 年度中国债券基金年度优秀纯债基金、2021 年度中国债券基金年度优秀可转债基金、2021 年度中国债券基金年度优秀信用债基金、2021 年度中国债券基金年度优秀可转债基金、2021 年度中国债券基金年度优秀信用债基金。

2021 年 9 月 10 日，在“2021 中国基金业年度评选”中，博时基金荣获“年度中国基金品牌”金奖、“蓝筹典范奖”、“双冠军”奖项。博时抗通胀回报股票基金荣获 2021 中国金融品牌“金象奖”之“2021 中国金融品牌年度十大杰出证券”。

4. 其他事件

1) 博时定期开放型证券投资基金首募顺利结束并于 2021 年 9 月 23 日正式成立。

2) 上述自然源开放型证券投资基金开放认购资金及关联基金 2021 年 3 月 15 日至 3 月 30 日完成了首次募集。

86. 基金运作目录

8.1.1 基金运作目录

8.1.1.1 中国证监会批准博时转债增强债券型证券投资基金设立的文件

8.1.2 转债增强债券型证券投资基金基金合同

8.1.3 转债增强债券型证券投资基金基金招募说明书

8.1.4 基金管理人业务资格、营业执照和公司章程

8.1.5 报告期内转债增强债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的备稿

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按本条规定申请复印

投资者到本基金的住所或办公场所，向本基金基金管理人或基金托管人

博时一线通：95105568（免长途费）

博时基金管理有限公司