博时现金收益证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年 6 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:2011 年 8 月 27 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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 2011 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	博时现金收益货币
基金主代码	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 1 月 16 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
报告期末基金份额总额	4,714,114,813.14 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

基金简称	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。
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资产配置。
业绩比较基准	本基金成立于 2004 年 1 月 16 日,业绩比较基准是一年期定期存款利率（税后）; 自 2009 年 7 月 1 日起,本基金的业绩比较基准变更为:活期存款利率（税后）。
风险收益特征	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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	张咏东
	联系电话	0755-83169999	021-32169999
	电子邮箱	service@bosera.com	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		95105568（免长途话费）	95559
传真		0755-83195140	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	87,852,887.18
本期利润	87,852,887.18
本期净值收益率	1.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2011 年 6 月 30 日）
期末基金资产净值	4,714,114,813.14
期末基金份额净值	1.0000

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。

本基金利润分配是按月结转份额。

3.2 基金净值表现

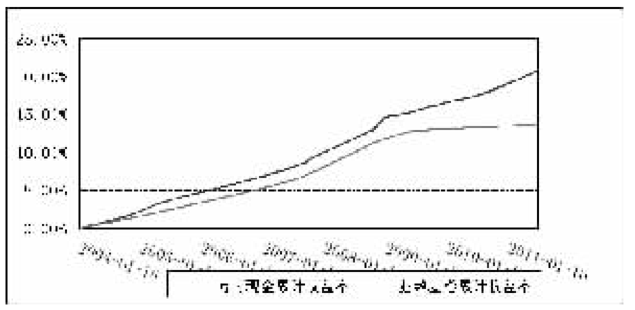
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.3668%	0.0073%	0.0417%	0.0000%	0.3251%	0.0073%
过去三个月	0.9091%	0.0047%	0.1250%	0.0001%	0.7841%	0.0046%
过去六个月	1.5539%	0.0039%	0.2207%	0.0002%	1.3332%	0.0037%
过去一年	2.9791%	0.0092%	0.4047%	0.0002%	2.5744%	0.0090%
过去三年	8.1933%	0.0093%	3.6968%	0.0035%	4.4965%	0.0058%
自基金成立起至今	20.9329%	0.0064%	13.6688%	0.0031%	7.2641%	0.0033%

注:本基金成立于 2004 年 1 月 16 日,业绩比较基准是一年期定期存款利率（税后）;

自 2009 年 7 月 1 日起,本基金的业绩比较基准变更为:活期存款利率（税后）。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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本基金合同第十六条（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。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司（以下简称"公司"）经中国证监会证监基字［1998］26 号文批准设立。注册资本为一亿元人民币,总部设在深圳,在北京、上海、沈阳和郑州设有分公司;并设有海外子公司:博时基金（国际）有限公司。目前公司股东为招商证券股份有限公司,持有股份 49%;中国长城资产管理公司,持有股份 25%;天津港（集团）有限公司,持有股份 6%;璟安实业有限公司,持有股份 6%;上海盛业资产管理有限公司,持有股份 6%;丰益实业发展有限公司,持有股份 6%;广厦建设集团有限责任公司,持有股份 2%。

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。"为国民创造财富"是博时的使命。博时的投资理念是"做投资价值的发现者"。截至 2011 年 6 月 30 日,博时基金公司共管理二十五只开放式基金和二只封闭式基金,并且受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金,以及多个企业年金账户,资产管理总规模逾 1856.66 亿元,累计分红超过人民币 552.64 亿元,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同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计,截至 2011 年 6 月 30 日,二季度博时基金参与排名的 15 只公募主动基金中,共有 11 只位列市场前 50%。其中,博时主题行业基金、博时特许价值基金分列 217 只标准股票基金第 3、第 9;博时平衡配置混合基金位列 14 只股债平衡型基金第 8;博时价值增长基金、博时价值增长贰号基金分列 29 只混合偏股型基金第 3 和第 4; 博时裕隆封闭基金位列 30 只封闭式基金第 2; 博时信用债券 A/B、博时信用债券 C、博时宏观回报债券 A/B、博时宏观回报债券 C 分列 64 只普通债券型基金（二级）第 7、第 8、第 9 和第 10。

2、客户服务

2011 年 1 月至 6 月底,博时在北京、山东、南京、唐山、无锡、上海、广州、厦门等地圆满举办博时基金大学、理财沙龙等各类活动共计 75 场;通过网络会议室举办的博时快 e 财富论坛、博时 e 视界等活动共计 36 场;通过这些活动,博时与投资者充分沟通了当前市场的热点问题,受到了投资者的广泛欢迎。

3、品牌获奖

1）2011 年 1 月 19 日,博时公司获得由《亚洲资产管理》（Asia Asset Management）杂志颁发的"2010 年度中国最佳投资者教育奖"。.

2）2011 年 4 月,在由上海证券报主办的第八届中国"金基金奖"评选中,博时平衡配置混合型证券投资基金再度荣膺 2010 年度"金基金三年期产品奖·平衡型基金奖",博时稳定价值债券投资基金荣获 2010 年度"金基金三年期产品奖·债券基金奖"。

3）博时平衡配置混合基金在由中国证券报社主办、银河证券等机构协办的第八届（2010 年度）中国基金业金牛奖评选中获评为"三年期混合型金牛基金奖"。这是继 2010 年荣获"三年期开放式混合型持续优胜金牛基金"奖之后,因持续稳定的投资管理能力再度蝉联同一金牛奖项。

4）2011 年 6 月 28 日,世界品牌实验室发布了 2011 年中国 500 最具价值品牌榜,博时基金管理公司凭着 2010 年持续的品牌创新和优秀的客户服务,品牌价值首次突破 50 亿元,以 56.24 亿元的品牌价值,位列品牌榜 227 名,连续 8 年成为国内最具品牌价值的基金公司。

4、其他大事件

1）2011 年 3 月 19 日,博时公司深圳员工在莲花山公园种下了第七片"博时林",自 2003 年至今,博时基金已先后在深圳中心公园、笔架山公园、大沙河公园、南山公园、梅林公园等地开辟了七片"博时林"。

2）博时抗通胀增强回报（QDII-FOF）基金首募顺利结束并于 2011 年 4 月 25 日成立。

3）深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金及博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金首募顺利结束并于 2011 年 6 月 10 日成立。

4）博时裕祥分级债券型证券投资基金首募顺利结束并于 2011 年 6 月 10 日成立。

5）博时卓越品牌股票型证券投资基金（LOF）是由博时裕泽封闭基金转型而来,基金合同于 2011 年 4 月 22 日生效,5 月份进行了集中申购,并于 2011 年 6 月 30 日在深交所上市交易。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张勇	基金经理	2006-7-1	-	8	2001年起先后在南京市商业银行北清支行、南京市商业银行资金营运中心工作。2003 年加入博时公司,历任债券交易员、现金收益基金经理助理兼任债券交易员。现任现金收益基金经理、博时策略混合、博时稳定价值债券基金基金经理。

注:上述人员的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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度。

4.3.2 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旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年,国际环境变化莫测,美国在 QE2 之后,经济并没有明显复苏,欧洲债务危机愈演愈烈。国内通胀同比快速上升,央行连续 6 次上调存款准备金率,3 次加息。

回顾上半年债券市场,绝大部分时间市场表现稳健,利率产品收益保持稳定,信用产品需求旺盛,收益节节下降。经过多次提高存款准备金率,银行间资金开始出现紧张,加之通胀影响,6 月末开始出现价格大幅下跌,信用债在城投类产品的担忧下,几乎完全丧失流动性。

我们在年初判断资金市场不会重复宽松的局面,因此,保留的大量现金成为我们最有利的进攻武器。回购成为上半年最优投资品种,短融收益也逐步走高,我们同时也加大了该类资产配置。利率产品在高企的回购成本下,显得非常无力,对该类资产,我们没有进行配置。

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 1.55%,业绩基准增长率为 0.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年,预计通胀数据将缓慢回落,加之国际与国内经济增长出现反复,紧缩政策将有所放缓。利率产品在经过一轮调整过后,有可能迎来一次反弹。而信用产品,在供给的巨大冲击下,以及之前市场大量杠杆性投资降杠杆的影响,会有一个信用风险的重新定价。

回购与存款仍是本基金下半年投资的主要标的,在仔细甄别信用风险的基础上,短融我们仍然会坚持投资。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益,设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称"估值委员会"）,制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成,基金经理原则上不参与估值委员会的工作,其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历,具备良好的专业经验和专业胜任能力,具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有:保证基金估值的公平、合理;制订健全、有效的估值政策和程序;确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性;定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内,本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金采用 1.00 元固定份额净值交易方式,自基金成立日起每日将实现的基金净收益分配给基金份额持有人,并按月结转到投资人基金账户,使基金账面份额净值始终保持 1.00 元。

本基金本报告期内向份额持有人分配利润 87,852,887.18 元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011 年上半年度,托管人在博时现金收益证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 年上半年度,博时基金管理有限公司在博时现金收益证券投资基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。本基金本报告期内向份额持有人分配利润:87,852,887.18 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2011 年上半年度,由博时基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关博时现金收益证券投资基金的半年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体:博时现金收益证券投资基金

报告截止日:2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资产	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资产:		
银行存款	806,013,550.63	1,351,890,560.92
结算备付金	10,501,915.60	9,874,904.63
存出保证金	-	-
交易性金融资产	2,120,790,332.58	3,483,787,915.49
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,120,790,332.58	3,483,787,915.49
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	2,276,045,454.06	210,001,035.00
应收证券清算款	-	49,899,985.71
应收利息	43,652,208.91	39,993,217.34
应收股利	-	-
应收申购款	213,697,070.08	660,754.58
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	20,000.00
资产总计	5,470,700,531.86	5,146,128,373.67
负债和所有者权益	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	750,998,704.50	279,999,660.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,557,121.79	1,445,944.35
应付托管费	471,855.10	438,164.93
应付销售服务费	1,179,637.70	1,095,412.38
应付交易费用	63,920.46	33,932.70
应交税费	1,518,769.57	940,100.00
应付利息	104,172.21	34,758.97
应付利润	493,183.11	966,972.91
递延所得税负债	-	-
其他负债	198,354.28	100,000.00
负债合计	756,585,718.72	285,054,946.24
所有者权益:		
实收基金	4,714,114,813.14	4,861,073,427.43
未分配利润	-	-
所有者权益合计	4,714,114,813.14	4,861,073,427.43
负债和所有者权益总计	5,470,700,531.86	5,146,128,373.67

注:报告截止日 2011 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.0000 元,基金份额总额 4,714,114,813.14 份。

6.2 利润表

会计主体:博时现金收益证券投资基金

本报告期:2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资产	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入	113,456,111.56	87,481,792.01
1.利息收入	106,346,397.97	86,570,676.42
其中:存款利息收入	31,273,242.61	25,114,124.70
债券利息收入	55,822,216.01	48,453,412.79
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	19,250,939.35	13,003,138.93
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	7,099,713.59	911,115.59
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7,099,713.59	911,115.59
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-	-
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	10,000.00	-
减:二、费用	25,603,224.38	30,710,395.68
1.管理人报酬	9,340,927.40	13,383,136.27
2.托管费	2,830,584.12	4,055,495.77
3.销售服务费	7,076,460.16	10,138,739.68
4.交易费用	-	-
5.利息支出	6,106,876.19	2,882,000.63
其中:卖出回购金融资产支出	6,106,876.19	2,882,000.63
6.其他费用	248,376.51	251,023.33
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	87,852,887.18	56,771,396.33
减:所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	87,852,887.18	56,771,396.33

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体:博时现金收益证券投资基金

本报告期:2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,861,073,427.43	-	4,861,073,427.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	87,852,887.18	87,852,887.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	-146,958,614.29	-	-146,958,614.29
其中:1.基金申购款	16,202,583,079.89	-	16,202,583,079.89
2.基金赎回款	-16,349,541,694.18	-	-16,349,541,694.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	-	-87,852,887.18	-87,852,887.18
五、期末所有者权益（基金净值）	4,714,114,813.14	-	4,714,114,813.14
项目	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	15,134,457,407.06	-	15,134,457,407.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	56,771,396.33	56,771,396.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	-9,756,849,874.88	-	-9,756,849,874.88
其中:1.基金申购款	15,133,307,824.99	-	15,133,307,824.99
2.基金赎回款	-24,890,157,699.87	-	-24,890,157,699.87
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	-	-56,771,396.33	-56,771,396.33
五、期末所有者权益（基金净值）	5,377,607,532.18	-	5,377,607,532.18

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:肖风,主管会计工作负责人:王德英,会计机构负责人:成江

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年报报告相一致。

6.4.2 关联方关系

6.4.2.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.2.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（"博时基金"）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（"交通银行"）	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司（"招商证券"）	基金管理人的股东、基金代销机构

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.3.1.1 股票交易

无。

6.4.3.1.2 权证交易

无。

6.4.3.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.3.2 关联方报酬

6.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,340,927.40	13,383,136.27
其中:支付销售机构的客户维护费	1,065,257.79	1,595,455.77

注:支付基金管理人博时基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数。

6.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,830,584.12	4,055,495.77

注:支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.3.2.3 销售服务费

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
	当期发生的应支付的销售服务费
博时基金	3,267,142.52
交通银行	261,701.93
招商证券	68,157.13
合计	3,597,001.58
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
博时基金	939,666.23
交通银行	371,579.06
招商证券	90,239.84
合计	1,401,485.13

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给博时基金,再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	-	-	-	-	180,000,000.00	24,904.11
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	102,652,500.00	-	-	-	-	-

6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.3.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2011年 6 月 30 日		上年度末 2010年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券	-	-	0.81	0.00%

6.4.3.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	6,013,550.63	70,601.59	1,265,614.48	45,538.11

注:1、本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按约定利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按约定利率计息。于 2011 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示（2010 年 6 月 30 日:同）。

6.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日				数量（单位:张）	总金额
招商证券	1181099	11兵建工 CP01	簿记建档集中配售	100,000	10,000,000.00
	1181089	11美邦 CP01	簿记建档集中配售	200,000	20,000,000.00
上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	数量（单位:张）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.4 期末（2011 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2011 年 6 月 30 日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 750,998,704.50 元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1081360	10华天 CP01	2011-07-01	100.00	300,000	30,000,295.98
1081292	10盾安 CP01	2011-07-01	99.87	400,000	39,946,199.36
1081221	10华泰 CP01	2011-07-01	100.00	350,000	35,000,000.00
1081429	10西王 CP02	2011-07-01	100.08	400,000	40,033,592.63
1081410	10申华 CP01	2011-07-01	99.99	300,000	29,995,759.16
1081398	10原水 CP01	2011-07-01	100.19	400,000	40,074,620.05
1081262	10超声 CP01	2011-07-01	100.02	100,000	10,001,785.98
100231	10国开 31	2011-07-01	99.99	1,000,000	99,989,141.67
080221	08国开 21	2011-07-01	99.58	1,000,000	99,584,907.39
070219	07国开 19	2011-07-01	100.70	500,000	50,347,635.53
010212	01国开 12	2011-07-01	100.40	1,000,000	100,395,932.03
110222	11国开 22	2011-07-01	99.92	1,000,000	99,921,564.11
1081387	10众和 CP01	2011-07-01	99.96	300,000	29,988,868.24
1081349	10渝涪高 CP01	2011-07-01	99.99	400,000	39,994,215.68
1081340	10天音 CP02	2011-07-01	100.00	300,000	30,000,000.00
合计		-	-	7,750,000	775,274,517.81

6.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

无余额。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	2,120,790,332.58	38.77
	其中:债券	2,120,790,332.58	38.77
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,276,045,454.06	41.60
	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	816,515,466.23	14.93
4	其他各项资产	257,349,278.99	4.70
5	合计	5,470,700,531.86	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	6.10	
	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（%）
2	报告期末债券回购融资余额	750,998,704.50	15.93
	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

本报告期内没有债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	97
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	145
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	94

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

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	52.03	15.93
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	4.36	0.00
2	30天（含）—60 天	0.21	0.00
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90 天	12.52	0.00
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.07	-
4	90天（含）—180 天	26.31	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180天（含）—397 天（含）	19.52	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
6	合计	110.59	15.93

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	450,239,180.73	9.55
	其中:政策性金融债	450,239,180.73	9.55
4	企业债券	205,357,153.68	4.36
5	企业短期融资券	1,465,193,998.17	31.08
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	2,120,790,332.58	44.99
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	255,704,789.21	5.42

7.5 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券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	0980147	09中航工债浮	2,000,000	205,357,153.68	4.36
2	010212	01国开 12	1,000,000	100,395,932.03	2.13
3	100231	10国开 31	1,000,000	99,989,141.67	2.12
4	110222	11国开 22	1,000,000	99,921,564.11	2.12
5	080221	08国开 21	1,000,000	99,584,907.39	2.11
6	070219	07国开 19	500,000	50,347,635.53	1.07
7	1081412	10青投 CP01	500,000	50,099,242.78	1.06
8	1181216	11博源 CP01	500,000	50,007,687.90	1.06
9	1181091	11瑞水泥 CP01	500,000	50,001,226.85	1.06
10	1181068	11蓉希望 CP01	500,000	49,981,465.98	1.06

7.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.19%
报告期内偏离度的最低值	-0.14%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.09%

7.7 期末按公允价值占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细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持 1.00 元。

7.8.2 本基金在报告期内不存在持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮息债的摊余成本超过基金资产净值 20%的情况。

7.8.3 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责、处罚。

7.8.4 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	43,652,208.91
4	应收申购款	213,697,070.08
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	257,349,278.99

7.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
50,056	94,176.82	2,330,411,298.26	49.43%	2,383,703,514.88	50.57%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	-	2,854,634.12	0.06%
	合计	2,854,634.12	0.06%

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日（2004 年 1 月 16 日）基金份额总额	6,285,920,856.25
本报告期期初基金份额总额	4,861,073,427.43
本报告期基金总申购份额	16,202,583,079.89
减:本报告期基金总赎回份额	16,349,541,694.18
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,714,114,813.14

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国元证券	1	-	-	-	-	-

注:本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字［2007］48 号）的有关规定要求,我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后,向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下:

（1）经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;

（3）具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下:

（1）本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。

（2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金在本报告期内不存在偏离度绝对值在 0.5%（含）以上的情况。

博时基金管理有限公司
2011 年 8 月 27 日