博时现金收益证券投资基金

更新招募说明书摘要

2009年第1号

博时现金收益证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会于2003年12月5日证监基金字〔2003〕134号文批准公开发行。本基金的基金合同于2004年1月16日正式生效。本基金为契约型开放式。

重要提示

博时基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“管理人”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，也不保证最低收益。

投资者在办理基金业务时提交的资料信息须真实、有效。于交易日（T日）提交的申请，投资者应在T+2日到销售网点柜台或销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况，投资者提交的申请经注册登记人确认（或不被确认）的后果由投资者承担。

投资有风险，过往业绩并不代表将来业绩。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

投资者在申购本基金前应认真阅读本招募说明书。

本更新招募说明书摘要根据本基金合同和本基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金招募说明书自基金合同生效日起，每6个月更新一次，并于每6个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每6个月的最后1日。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2009年1月16日，有关财务数据和净值表现截止日为2008年12月31日(财务数据未经审计)。

一.基金管理人

（一）基金管理人概况

名　称：博时基金管理有限公司
注册地址：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：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层
法定代表人：杨鶤
成立时间：1998年7月13日
注册资本：1亿元人民币
存续期间：持续经营
电　话：（0755）83169999
联系人：李全

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。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份73%；中国长城资产管理公司，持有股份25%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份2%。注册资本为1亿元人民币。

公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设十三个直属部门和两大销售业务体系，分别是：总裁办公室、股票投资部、特定资产管理部、固定收益部、研究部、交易部、产品规划部、市场部、基金运作部、财务部、信息技术部、监察法律部、人力资源部、零售业务和机构业务。总裁办公室专门负责公司的战略规划研究、行政后勤支持、会议及文件管理、公司文化建设、外事活动管理、档案管理、董事会、党办及工会工作。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。特定资产管理部负责特定资产的管理和客户咨询服务。固定收益部负责进行固定收益证券的选择和组合管理。研究部负责完成对宏观经济、行业公司及市场的研究。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。产品规划部负责新产品设计、产品维护和业绩分析等。市场部负责基金营销策划、渠道沟通、国际业务开发等工作。基金运作部负责基金会计、基金注册登记、直销及客户服务业务。财务部负责公司财务事宜。信息技术部负责系统开发、网络运行及维护。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察，并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、人事信息管理工作。零售业务下辖北京区域、上海区域、南方区域和客户服务中心，负责公司全国范围内的零售客户、渠道销售和服务工作。机构业务负责公司全国范围内的机构客户销售和服务工作。机构业务下辖养老金业务部、年金顾问部、战略客户部、机构理财部－上海和机构理财部－南方。养老金业务部负责养老金业务的研究、拓展和服务等工作。年金顾问部负责为客户提供年金方案设计与精算等企业年金咨询工作。战略客户部负责北方地区由国资委和财政部直接管辖企业以及该区域机构客户的销售与服务工作。机构理财部－上海和机构理财部－南方分别主要负责华东地区、华南地区以及其他指定区域的机构客户销售与服务工作。另设北京分公司和上海分公司，分别负责对驻京沪人员日常行政管理和对赴京沪处理公务人员给予协助。

截止到2009年1月16日，总人数238人，其中61%以上的员工具有硕士以上学历。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

（二）主要成员情况

1.基金管理人董事会成员

杨鶤女士，硕士，董事长。1983年起先后在中国银行国际金融研究所、香港中银集团、招商银行证券部、深圳中大投资管理公司、长盛基金管理公司、中信基金管理有限公司工作。现任招商证券股份有限公司董事、总经理。

肖风先生，副董事长，博士学历。1989年入职深圳康佳电子集团股份有限公司，历任总经理办公室秘书、股份制改造委员会秘书、董事会秘书兼股证委员会主任，具体负责康佳公司股份制改造及A、B股发行和上市等筹备工作。1992年在中国人民银行深圳经济特区分行工作，历任证券管理处科长、副处长，具体负责深圳市A、B股发行及上市的审查工作。1993年进入深圳市证券管理办公室工作，历任副处长、处长、证管办副主任和深圳证券交易所上市委员会委员，主管深圳市上市公司A、B股发行审查、市场建设及监管稽查工作。1998年4月1日起负责筹建博时基金管理有限公司，现任副董事长、总裁。

汤维清先生，硕士，董事。1988年起先后在成都探矿工艺研究所、深圳天极光电技术股份有限公司、深圳中大投资管理有限责任公司、中信基金管理有限责任公司工作。现任招商证券股份有限公司副总裁。

王金宝先生，硕士，董事。1988年起先后在上海同济大学、招商证券股份有限公司工作，现任招商证券股份有限公司机构业务董事总经理。

周长青先生，硕士。历任中国人民银行银行司主任科员，中信银行支行负责人，中国民族信托投资公司理财总部副总经理，银河基金管理有限公司督察员（长）、董事会秘书等职。现任中国长城资产管理公司投资管理部副总经理。

陈小鲁先生，独立董事，高级经济师。历任中华人民共和国驻英国大使馆国防副武官，北京国际战略问题研究学会副秘书长，原中共中央政治体制改革研究室局长，亚龙湾开发股份有限公司总经理。现任标准国际投资管理公司董事长。

赵榆江女士，独立董事，经济学硕士。历任国家经济体制改革委员会研究员，英国高诚证券(香港)有限公司董事，北京代表处首席代表，法国兴业证券(香港)有限公司董事总经理。现任康联马洪(中国)投资管理有限公司董事、高级投资顾问。

姚钢先生，独立董事，经济学硕士，研究员(教授)。历任中国社会科学院农村发展研究所副研究员，海南汇通国际信托投资公司证券业务部副总经理，深圳证券交易所上市委员会委员，深圳证券商协会副主席。现任中国社会科学院经济文化研究中心副主任。

2.基金管理人监事会成员

夏永平女士，硕士，监事。1984年起先后在中国农业银行总行、中国长城信托投资公司、中国长城资产管理公司工作。2000年7月起任博时基金管理有限公司董事。

车晓昕女士，硕士，监事。1983年起先后在郑州航空工业管理学院、珠海证券有限公司、招商证券股份有限公司投资银行总部工作。现任招商证券股份有限公司财务部总监。

郑波先生，博士，监事。2001年起先后在中国平安保险公司总公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司人力资源部总经理。

3.公司高管人员

杨鶤女士，简历同上。

肖风先生，简历同上。

李全先生，硕士，博时基金管理有限公司副总裁。1988年在中国人民银行总行金融研究所工作，同年进入中国农村信托投资公司。1991年进入正大国际财务有限公司工作，历任北京代表处首席代表、资金部总经理、总经理助理。1998年5月加入博时基金管理有限公司，任督察员兼监察部经理。2000年至2001年，在梅隆信托的伦敦总部及其下属牛顿基金管理公司工作。2001年4月回到博时任副总经理，主管公司投资业务。2003年主管公司运作部门和市场营销部门。2005年1月获得“2004年度中国优秀CIO”称号；2006年2月获得由亚洲权威的资产管理专业杂志《亚洲资产管理》颁发的“2005年度亚太地区最佳营销人物奖”；2007年12月荣获“2007年度深圳市金融创新奖一等奖”。李全先生注重金融创新与风险控制，倡导规范管理和标准化运作，对博时的规范化建设起了重要作用。此外，他还在新华富时指数委员会担任委员。

王德英先生，硕士。1995年起先后任北京清华计算机公司开发部经理、清华紫光股份公司CAD与信息事业部工作。2000年加入博时基金管理有限公司，历任行政管理部副经理，电脑部副经理及信息技术部总经理。现任公司副总裁。

孙麒清女士，商法学硕士。曾供职于广东深港律师事务所。2002年加入博时基金管理有限公司，曾任监察法律部法律顾问，现任公司督察长兼监察法律部总经理。

4.本基金基金经理

芮颖女士，双硕士学历。1992年毕业于中国人民大学获货币银行学学士学位。1995年毕业于中国人民银行研究生部，获国际金融硕士学位。1998－2000年就读于英国牛津大学，获经济学哲学硕士学位。1994年至1998年先后在中国人民银行外资金融机构管理司、中国人民银行常州分行和中国人民银行货币政策司利率处工作。2001年－2002年在香港瑞银华宝公司企业融资部兼并收购部任高级分析员。是中银香港重组上市项目（筹资金额200亿人民币）核心成员。其重点负责的中银香港信用评级顾问工作获Finance asia“年度最佳评级顾问奖”。2003年1月加入博时基金管理公司。在港工作期间获香港证券业协会（HKSI）投资顾问合格考试证书。

2006年7月，芮颖女士因工作调动，不再担任博时现金收益证券投资基金基金经理。经董事会批准，本公司聘请张勇先生担任博时现金收益证券投资基金基金经理。

张勇先生，学士。2001年毕业于南京审计学院金融学专业，获工学学士学位。2001年至2002年于南京市商业银行北清支行任信贷员。2002年至2003年，于南京市商业银行资金营运中心任债券交易员。2003年12月，入博时基金管理有限公司，任交易部债券交易员。2006年7月起，任现金收益基金经理。

5.投资决策委员会成员

主任委员：肖风

委员：李全、杨锐、陈亮、邵凯、董良泓、夏春、邹志新、张志峰。

肖风先生，(同上)

李全先生，(同上)

杨锐先生，博士。1999年毕业于南开大学国际经济研究所。1999年8月加入博时基金管理有限公司，先后担任研究部策略分析师、策略分析师兼博时价值增长基金基金经理助理、研究部副总经理兼策略分析师。2005年1月至2006年1月由博时公司派往纽约大学Stern商学院做访问学者。2005年6月至2006年1月在AllianceBernstein的股票投资部门工作。2006年1月回国继续担任研究部副总经理、策略分析师，5月兼任博时平衡配置基金经理。2008年1月任首席策略分析师，兼任混合组投资总监、博时价值增长基金经理、博时价值增长贰号基金经理、博时平衡配置混合型基金经理。现任首席策略分析师，兼任混合组投资总监、博时平衡配置混合型投资基金基金经理。

陈亮先生，硕士。1998年12月起先后在中信证券金融产品开发小组、北京玖方量子软件技术公司工作。2001年3月加入博时基金管理有限公司，历任金融工程师、博时价值增长基金经理助理、博时裕富基金经理、数量组投资总监兼任博时裕富基金经理，博时裕泽基金经理。现任股票投资部总经理，兼任数量组投资总监、博时裕泽基金经理、博时特许价值基金经理。

邵凯先生，经济学硕士。1997年8月起在河北省经济开发投资公司投资管理部工作。1999年9月至2000年7月在英国READING大学学习国际证券与投资银行专业，获硕士学位。2000年8月入博时基金管理有限公司，历任基金管理部债券组合经理助理、基金管理部债券组合经理、固定收益部债券投资经理、社保债券基金基金经理、固定收益部副总经理兼社保债券基金基金经理。现任固定收益部总经理兼社保债券基金基金经理。

董良泓先生，MBA。1993年起先后在中国技术进出口总公司财务部、中技投资公司、融通基金管理有限公司、长城基金管理有限公司工作。2005年2月加入博时基金管理有限公司，历任社保股票投资经理、社保股票基金经理、研究部总经理兼任特定资产高级投资经理、社保股票基金经理。现任特定资产管理部总经理，兼任股票投资部价值组投资总监、高级投资经理、社保股票基金经理。

夏春，经济学硕士。1996年毕业于上海交通大学管理工程系。1996年起先后在上海永道（现为普华永道）会计财务咨询公司、招商证券研发中心策略部工作。2004年2月加入博时基金管理有限公司，历任研究部宏观与策略研究员、研究部副总经理，兼任策略分析师、博时平衡配置基金基金经理助理。现任研究部总经理，兼任策略分析师、博时价值增长基金、博时价值增长贰号基金基金经理。

邹志新先生，博士，中国注册会计师协会非执业注册会计师。1992年毕业于北京理工大学，获理学学士学位，1997年在江西财经大学获经济学硕士学位，2008年获南开大学经济学博士学位。1997年至1999年在君安证券研究所从事研究工作，任核心研究员。1999年加入博时基金管理有限公司，曾任研究员、交易员、基金裕隆基金经理助理。历任研究员、交易员、基金裕隆基金经理助理、基金裕泽基金经理、基金裕元基金经理。现任成长组投资总监兼任第三产业成长基金经理。

张志峰先生，博士。1996年5月起先后在摩根士丹利集团、巴克莱全球投资集团、LABRENCHE STRUCTUR PRODUCTS工作。2008年1月加入博时基金管理有限公司，现任股票投资部另类投资组投资总监。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二.基金托管人

(一)基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）
公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人：胡怀邦
住所：上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码：200120
注册时间：1987年3月30日
注册资本：489.94亿元
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】25号
联系人：张咏东
电话：021－68888917

部门设置情况

交通银行是中国第一家全国性国有股份制商业银行，自1987年重新组建以来，交通银行各项业务和机构建设持续健康发展，目前在我国156个城市设有2600多营业网点，全行员工7万余人。按国际财务报告准则审计口径，截止2008年6月30日，交通银行资产总额达到人民币24,308.59亿元，实现净利润人民币155.08亿元。2005年6月23日，交通银行成功在香港主板市场上市，成为首家在境外上市的内地商业银行；2006年11月18日，交通银行成为中国2010年上海世博会商业银行全球合作伙伴；2007年5月15日，交通银行成功在上海证券交易所上市。2007年，根据英国《银行家》杂志发布的“2007年世界1000家银行”排名，交通银行总资产排名第69位，一级资本排名第68位；被国际权威杂志《欧洲货币》评为2007年度“中国最佳私人财富管理银行”。

交通银行总行设资产托管部，现有员工100余人。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，并具有经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(二)主要人员情况

李军先生，交通银行行长，华中理工大学经济学硕士，高级经济师。曾任交通银行武汉分行副总经理、行长，交通银行总稽核、董事、常务董事、执行董事、副行长；2006年9月担任交通银行副董事长、行长。

王滨先生，交通银行副行长，主管交通银行资产托管业务，南开大学经济学博士，高级经济师。曾任交通银行北京分行副行长、交通银行天津分行行长、交通银行北京分行行长。2006年1月至今任交通银行副行长、党委委员兼北京分行党委书记。

谷娜莎女士，交通银行资产托管部总经理。大学学历，经济师。曾任交通银行研究开发部主任科员、交通银行信托部代理业务处副处长、交通银行证券投资基金托管部规划处副处长、交通银行证券投资基金托管部内控巡查处处长；2001年1月任交通银行证券投资基金托管部总经理助理，2002年5月起任交通银行资产托管部副总经理，2007年12月起任交通银行资产托管部总经理。

(三)基金托管业务经营情况

截止2008年12月末，交通银行共托管证券投资基金42只，包括基金普惠、基金安顺、基金汉兴、基金科瑞、建信优势动力、华安创新基金、国泰金鹰增长基金、华夏债券基金、泰达荷银合丰系列基金（成长、周期、稳定）、鹏华普天系列基金（债券、收益）、海富通精选基金、博时现金收益基金、易方达50指数基金、融通行业景气基金、鹏华中国50基金、金鹰中小盘精选基金、富国天益价值基金、华安宝利基金、中海优质成长基金、银河银富货币市场基金、银华货币市场基金、泰达荷银风险预算基金、万家公用事业基金、天治核心成长基金、汇丰晋信2016生命周期基金、摩根士丹利华鑫货币市场基金、汇丰晋信龙腾基金、长城久富核心成长基金、汇丰晋信动态策略基金、华夏蓝筹核心基金、博时新兴成长基金、华安策略优选基金、易方达科讯基金、易方达科汇基金、天治创新先锋基金、金鹰红利价值基金、农银汇理行业成长基金、农银汇理恒久增利基金、汇丰晋信平稳增利基金。此外，还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等12类产品，托管资产规模超过四千亿元。

三.相关服务机构

(一)基金管理人

名称：	博时基金管理有限公司
注册地址：	广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层
法定代表人：	杨鶤
成立日期：	1998年7月13日
批准设立机关及批准设立文号：	中国证监会证监基金字【1998】26号
组织形式：	有限责任公司
实收资本：	1亿元人民币
存续期间：	持续经营
客户服务中心电话：	010－65171155
公司电话	0755－83169999
公司传真	0755－83195270

(二)注册登记人

博时基金管理有限公司（同上）

(三)基金托管人

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）
公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人：胡怀邦
住所：上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码：200120
注册时间：1987年3月30日
注册资本：489.94亿元
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】25号
联系人：张咏东
电话：021－68888917

(四)代销机构

1.交通银行股份有限公司

名称：	交通银行股份有限公司
注册地址：	上海市银城中路188号
办公地址：	上海市银城中路188号
法定代表人：	胡怀邦
电话：	021－68888917
传真：	021－58408483
联系人：	曹榕
客户服务电话：	95559
网址：	www.bankcomm.com

2.中国工商银行股份有限公司

名称：	中国工商银行股份有限公司
注册地址：	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址：	北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：	姜建清
电话：	010－66107900
传真：	010－66107914
客户服务电话：	95588
网址：	www.icbc.com.cn

3.中国建设银行股份有限公司

名称：	中国建设银行股份有限公司
注册地址：	北京市西城区金融大街25号
办公地址：	北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心1号楼
法定代表人：	郭树清
客户服务电话：	95533
网址：	www.ccb.com

7.中信银行股份有限公司

名称：	中信银行股份有限公司
注册地址：	北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：	陈小宪
电话：	010－65557020
传真：	010－65541281
联系人：	宋晓明
客户服务电话：	95558
网址：	www.ecitic.com

8.中国农业银行股份有限公司

名称：	中国农业银行股份有限公司
注册地址：	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：	北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：	项俊波
客户服务电话：	95599
网址：	www.abchina.com；www.95599.cn

9.北京银行股份有限公司

名称：	北京银行股份有限公司
注册地址：	北京市西城区金融大街17号北京银行大厦
办公地址：	北京市西城区金融大街17号北京银行大厦
法定代表人：	阎冰竹
联系人：	王光伟
电话：	010－66223236
传真：	010－66223214
客户服务电话：	010－96169
网址：	www.bankofbeijing.com.cn

10.中国民生银行股份有限公司

名称：	中国民生银行股份有限公司
注册地址：	北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：	北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：	董文标
联系人：	吴海鹏
电话：	010－58351666
传真：	010－83914283
客户服务电话：	95568
网址：	www.cmbc.com.cn

11.长江证券股份有限公司

名称：	长江证券股份有限公司
注册地址：	武汉市新华下路特8号
办公地址：	武汉市新华下路特8号
法定代表人：	胡运钊
联系人：	李良
电话：	027－65799560
传真：	027－85481532
客户服务电话：	400－8888－999
网址：	www.95579.com

12.东吴证券有限责任公司

名称：	东吴证券有限责任公司
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：	www.dwjq.com.cn

13.广发证券股份有限公司

名称：	广发证券股份有限公司
注册地址：	广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室
办公地址：	广东广州天河北路大都会广场36、37、41和42楼
法定代表人：	王志伟
联系人：	肖中梅
电话：	020－87555888
传真：	020－87557985
客户服务电话：	020－87555888转各营业网点
网址：	www.gf.com.cn

14.国泰君安证券股份有限公司

名称：	国泰君安证券股份有限公司
注册地址：	上海浦东新区商城路168号
法定代表人：	祝幼一
电话：	021－38676666
传真：	021－38670161
联系人：	芮敏祺
客户服务电话：	400－8888－666
网址：	www.gtja.com

15.国信证券有限责任公司

名称：	国信证券有限责任公司
注册地址：	深圳市红岭中路1012号国信证券大厦
办公地址：	深圳市红岭中路1010号国际证券大厦
法定代表人：	何如
联系人：	林建闽
电话：	0755－82130833
传真：	0755－82133302
客户服务电话：	800－810－8868
网址：	www.guosen.com.cn

16.海通证券股份有限公司

名称：	海通证券股份有限公司
办公地址：	上海市淮海中路98号－上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：	王开国
联系人：	金芸、李笑鸣
电话：	021－23219275
传真：	021－63410456
客户服务电话：	400－8888－001
网址：	www.htsec.com

17.中信建投证券有限责任公司

名称：	中信建投证券有限责任公司
注册地址：	北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人：	张佑君
电话：	010－85130588
传真：	010－65182261
联系人：	权唐
客户服务电话：	400－8888－108（免长途费）
网址：	www.csc108.com

18.联合证券有限责任公司

名称：	联合证券有限责任公司
注册地址：	深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
办公地址：	深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
法定代表人：	马昭明
联系人：	盛宗凌
电话：	0755－82492000
传真：	0755－82492962
客户服务电话：	400－8888－555，0755－25125666
网址：	www.lhzq.com

19.兴业证券股份有限公司

名称：	兴业证券股份有限公司
注册地址：	福州市湖东路99号标力大厦
办公地址：	上海市陆家嘴东路166号中保大厦
法定代表人：	兰荣
联系人：	杨盛芳
电话：	021－68419974
传真：	021－68419867
客户服务电话：	021－68419974
网址：	www.xyzq.com

20.招商证券股份有限公司

名称：	招商证券股份有限公司
注册地址：	深圳市益田路江苏大厦40－45层
法定代表人：	宫少林
联系人：	黄健
电话：	0755－82943666
传真：	0755－82943636
客户服务电话：	4008888111，95565
网址：	www.newone.com.cn

21.中国银河证券股份有限公司

名称：	中国银河证券股份有限公司
注册地址：	北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：	肖时庆
电话：	010－66568047
传真：	010－66568536
联系人：	李洋
客户服务电话：	010－68016655
网址：	www.chinastock.com.cn

22.光大证券股份有限公司

名称：	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
法定代表人：	徐浩明
电话：	021－68816000
传真：	021－68815009
联系人：	刘晨
客户服务电话：	10108998
网址：	www.ebscn.com

23.财通证券经纪有限责任公司

名称：	财通证券经纪有限责任公司
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：	0571－96336
网址：	www.ctsec.com

24.深圳发展银行股份有限公司

名称：	深圳发展银行股份有限公司
注册地址：	深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人：	法兰克纽曼
电话：	0755－82088888转8811
传真：	0755－82080714
联系人：	周　勤
客户服务电话：	95501
网址：	www.sdb.com.cn

25.湘财证券有限责任公司

名称：	湘财证券有限责任公司
注册地址：	湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址：	上海市浦东陆家嘴环路958号华能联合大厦5楼
法定代表人：	陈学荣
联系人：	钟康莺
电话：	021－68634518－8503
传真：	021－68865938
客户服务电话：	021－68865020
网址：	www.xcsc.com；www.eestart.com

26.东方证券股份有限公司

名称：	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
传真：	021－63326173
客户服务电话：	021－962506或40088－88506
网址：	www.dfzq.com.cn

27.长城证券有限责任公司

名称：	长城证券有限责任公司
注册地址：	深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
办公地址：	深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：	黄耀华
联系人：	高峰
电话：	0755－83516094
传真：	0755－83516199
客户服务电话：	0755－82288968
网址：	www.cc168.com.cn

28.浙商证券有限责任公司

名称：	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
法定代表人：	吴承根
联系人：	吴颖
电话：	0571－87901963
传真：	0571－87902081
客户服务电话：	0571－87902079
网址：	www.stocke.com.cn

29.平安证券有限责任公司

名称：	平安证券有限责任公司
办公地址：	深圳市八卦岭八卦三路平安大厦三楼
法定代表人：	陈敬达
联系人：	袁月 庄维佳
电话：	0755－82450826 22622287
传真：	0755－82433794
客户服务电话：	95511
网址：	www.pa18.com

30.世纪证券有限责任公司

名称：	世纪证券有限责任公司
注册地址：	深圳深南大道7088号招商银行大厦40－42楼
办公地址：	深圳深南大道7088号招商银行大厦40－42楼
法定代表人：	段强
电话：	0755－83199511
传真：	0755－83199545
联系人：	刘军辉、王飞
客户服务电话：	0755－83199511
网址：	www.csco.com.cn

31.华西证券有限责任公司

名称：	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：	深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼（深圳总部）
法定代表人：	张慎修
电话：	0755－83025046
传真：	0755－83025991
联系人：	王京红
客户服务电话：	4008－888－818
网址：	www.hx168.com.cn

29、申银万国证券股份有限公司

名称：	申银万国证券股份有限公司
注册地址：	上海市常熟路171号
法定代表人：	丁国荣
联系人：	黄维琳、曹晔
电话：	021－54033888
传真：	021－54038844
客户服务电话：	021－962505
网址：	www.sw2000.com.cn

30、上海浦东发展银行股份有限公司

名称：	上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：	上海市浦东南路500号
办公地址：	上海市北京东路689号东银大厦17楼
法定代表人：	金运
电话：	021－61616188－6152、6153
传真：	021－63602431
联系人：	汤嘉惠、倪苏云
客户服务电话：	95528
网址：	http://www.spdb.com.cn

31、招商银行股份有限公司

名称：	招商银行股份有限公司
注册地址：	深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人：	秦晓
电话：	0755－83195834；83195771
传真：	0755－83195049
联系人：	朱小姐、刘小姐
客户服务电话：	95555
网址：	http://www.cmbchina.com

32、江南证券有限责任公司

名称：	江南证券有限责任公司
注册地址：	江西省南昌市象山北路208号
办公地址：	江西省南昌市抚河北路291号江西教育出版大厦
法定代表人：	姚江涛
电话：	0791－6768763
传真：	0791－6789414
联系人：	余雅娜
客户服务电话：	0791－6794724
网址：	http://www.scstock.com/

33、大同证券经纪有限责任公司

名称：	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：	山西省太原市青年路8号
法定代表人：	董祥
电话：	0351－4167056
传真：	0351－4192803
联系人：	苏妮
客户服务电话：	0351－4167056
网址：	www.dtsbc.com.cn

34、中信万通证券有限责任公司

名称：	中信万通证券有限责任公司
注册地址：	青岛市东海西路28号
办公地址：	青岛市东海西路28号
法定代表人：	史洁民
电话：	0532－85022026
传真：	0532－85022026
联系人：	丁韶燕
客户服务电话：	0532－96577
网址：	www.zxwt.com.cn

35、中信金通证券有限责任公司

名称：	中信金通证券有限责任公司
注册地址：	浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
办公地址：	浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
法定代表人：	刘军
电话：	0571－85783715
传真：	0571－85783771
联系人：	俞会亮
客户服务电话：	96598
网址：	www.96598.com.cn

36、国海证券有限责任公司

名称：	国海证券有限责任公司
注册地址：	广西南宁市滨湖路46号
办公地址：	广西南宁市滨湖路46号
法定代表人：	张雅锋
电话：	（0771）5539262
传真：	（0771）5539033
联系人：	覃清芳
客户服务电话：	4008888100（全国）、96100（广西）
网址：	http://www.ghzq.com.cn

37、华林证券有限责任公司

名称：	华林证券有限责任公司
注册地址：	广东省江门市港口路1号
办公地址：	广东省深圳市振华路21号航天立业大厦三楼
法定代表人：	姚桥盛
电话：	0755－83749454
传真：	0755－83749248
联系人：	杨玲
客户服务电话：	北京：010－64405981 上海：021－52905648 深圳：0755－83040035 广州：020－81969715 长沙：0731－2329088 合肥：0551－2883033 江门：0750－3160388
网址：	www.chinalions.com

38、华泰证券股份有限公司

名称：	华泰证券股份有限公司
注册地址：	江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址：	江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：	吴万善
电话：	025－84457777
传真：	025－84579879
联系人：	李金龙
客户服务电话：	95597
网址：	http://www.htsc.com.cn

39、中信证券股份有限公司

名称：	中信证券股份有限公司
注册地址：	北京市朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人：	王东明
联系人：	陈忠
电话：	010－84588888
传真：	010－84865560
客户服务电话：	010－84588818－266
网址：	www.cs.ecitic.com

40、天相投资顾问有限公司

名称：	天相投资顾问有限公司
注册地址：	北京市西城区金融街19号富凯大厦B座
办公地址：	北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：	林义相
联系人：	陈少震
电话：	010－66045522
传真：	010－66045500
客户服务电话：	010－66045678
网址：	www.txsec.com；www.txjijin.com

41、信泰证券有限责任公司

名称：	信泰证券有限责任公司
注册地址：	南京市长江路88号
办公地址：	南京市长江路88号
法定代表人：	钱凯法
电话：	025－84784765
传真：	025－84784741
联系人：	舒萌菲
客户服务电话：	4008888918
网址：	www.thope.com

42、国联证券有限责任公司

名称：	国联证券有限责任公司
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
电话：	0510－82831662
传真：	0510－82830162
联系人：	袁丽萍
客户服务电话：	4008885288(全国热线)，0510－82588168（无锡）
网址：	www.glsc.com.cn

43、国盛证券有限责任公司

名称：	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：	江西省南昌市永叔路15号信达大厦10－13楼
法定代表人：	管荣升
电话：	0791－6285337
传真：	0791－6289395
联系人：	徐美云
客户服务电话：	0791－6285337
网址：	www.gsstock.com

44、安信证券股份有限公司

名称：	安信证券股份有限公司
注册地址：	深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
办公地址：	深圳市福田区深南大道2028号中国凤凰大厦1号楼7层
法定代表人：	牛冠兴
电话：	0755－82558323
传真：	0755－82558355
联系人：	余江
客户服务电话：	4008001001
网址：	www.axzq.com.cn

45、东莞证券有限责任公司

名称：	东莞证券股份有限责任公司
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：	陈就明
电话：	0769－22118336
传真：	0769－22118336
联系人：	张建平
客户服务电话：	961130
网址：	www.dgzq.com.cn

46、中原证券股份有限公司

名称：	中原证券股份有限公司
注册地址：	许昌市南关大街38号
办公地址：	郑州市经三路15号广汇国贸11楼
法定代表人：	石保上
电话：	0371－65585670
传真：	0371－65585670
联系人：	程月艳
客户服务电话：	0371－967218
网址：	www.ccnew.com www.zyzq.cn

47、华龙证券有限责任公司

名称：	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
电话：	0931－8888088
传真：	0931－4890515
联系人：	李昕田
客户服务电话：	0931－4890619 4890618 4890100
网址：	http://www.hlzqgs.com

48、广州证券有限责任公司

名称：	广州证券有限责任公司
注册地址：	广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼
办公地址：	广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼
法定代表人：	吴志明
电话：	020－87322668
传真：	020－87325036
联系人：	樊刚正
客户服务电话：	020－961303
网址：	www.gzs.com.cn

49、万联证券有限责任公司

名称：	万联证券有限责任公司
注册地址：	广州市中山二路18号广东电信广场36－37层
办公地址：	广州市中山二路18号广东电信广场36－37层
法定代表人：	李舫金
电话：	020－37865188
传真：	020－37865008
联系人：	李俊
客户服务电话：	4008888133
网址：	www.wlzq.com.cn

50、恒泰证券有限责任公司

名称：	恒泰证券有限责任公司
注册地址：	内蒙古呼和浩特市新华东街111号邮编010010
办公地址：	内蒙古呼和浩特市新华东街111号邮编010010
法定代表人：	刘汝军
电话：	0471－4913998
传真：	0471－4930707
联系人：	常向东
客户服务电话：	0471－4961259
网址：	www.cnht.com.cn

51、南京证券有限责任公司

名称：	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
电话：	025－83364032
传真：	025－83320066
联系人：	胥春阳
客户服务电话：	4008285888
网址：	www.njzq.com.cn

52、中国光大银行股份有限公司

名称：	中国光大银行股份有限公司
注册地址：	北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
办公地址：	北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人：	唐双宁
电话：	010－68098778
传真：	010－68560661
联系人：	李伟
客户服务电话：	95595
网址：	www.cebbank.com.

53、广东发展银行

名称：	广东发展银行
注册地址：	广州市农林下路83号
办公地址：	广州市农林下路83号
法定代表人：	李若虹
电话：	020－38323701
传真：	010－87311780
联系人：	赵亮
客户服务电话：	020－38322542，020－38322974
网址：	www.gdb.com.cn

54、中银国际证券有限责任公司

名称：	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
电话：	021－68604866
传真：	021－50372474
联系人：	张静
客户服务电话：	4006208888
网址：	www.bocichina.com.cn

55、国元证券股份有限公司

名称：	国元证券股份有限公司
注册地址：	安徽省合肥市寿春路179号
办公地址：	安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人：	凤良志
电话：	0551－2207114
联系人：	程维
客户服务电话：	全国统一热线4008888777，安徽省内热线96888
网址：	www.gyzq.com.cn

56、中国建银投资证券有限责任公司

名称：	中国建银投资证券有限责任公司
注册地址：	深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48－50层
办公地址：	深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A座19楼
法定代表人：	杨小阳
电话：	0755－82026521
传真：	0755－82026539
联系人：	刘权
客户服务电话：	4006208888
网址：	www.cjis.cn

57、中国国际金融有限公司

名称：	中国国际金融有限公司
注册地址：	中国北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层
办公地址：	中国北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层
法定代表人：	汪建熙
电话：	010－65051166
传真：	010－65051156
联系人：	王雪筠
客户服务电话：	北京010－85679238、85679169 上海021－63861195、63861196 深圳0755－83195000
网址：	www.cicc.com.cn\www.ciccs.com.cn

58、浙商银行股份有限公司

名称：	浙商银行股份有限公司
注册地址：	浙江省杭州市庆春路288号
办公地址：	浙江省杭州市庆春路288号
法定代表人：	张达洋
电话：	0571－87659084
传真：	0571－87659188
联系人：	吴军阳
客户服务电话：	95105665
网址：	http://www.czbank.com

59、上海农村商业银行股份有限公司

名称：	上海农村商业银行股份有限公司
注册地址：	上海市浦东新区浦东大道981号
办公地址：	上海市延安西路728号华敏瀚尊国际25－26楼
法定代表人：	李秀仑
客户服务电话：	021－962999
联系人：	翁敏芬
电话：	021－62126969－1156
网址：	http://www.shrcb.com

60、宏源证券股份有限公司

名称：	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：	北京市海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层
法定代表人：	汤世生
电话：	010－62294608
传真：	010－62296854
客户服务电话：	0351－4167056
网址：	www.dtsbc.com.cn

61、瑞银证券有限责任公司

名称：	瑞银证券有限责任公司
注册地址：	北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址：	北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人：	刘弘
电话：	010－59226788
传真：	010－59226840
联系人：	谢亚凡
客户服务电话：	400－887－8827
网址：	www.ubssecurities.com

（五）直销机构

博时基金管理有限公司（同上）

（六）律师事务所

名称：	国浩律师集团（北京）事务所
注册地址：	北京市东城区建国门内大街贡院六号E座9层
办公地址：	北京市东城区建国门内大街贡院六号E座9层
负责人：	王卫东
电话：	010－65171188
传真：	021－65176800
联系人：	黄伟民
经办律师：	黄伟民、陈周

（七）会计师事务所

名称：	普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址：	上海市浦东新区东昌路568号
办公地址：	上海湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：	杨绍信
电话：	021－61238888
传真：	021－61238800
联系人：	陈兆欣
经办注册会计师：	薛竞、陈宇

四.基金的名称

博时现金收益证券投资基金

五.基金的类型

货币市场基金

六.基金的投资目标

在保持低风险和高流动性的前提下获得高于投资基准的回报。

七.基金的投资方向

1、到期期限在一年以内的国债、金融债、央行票据、AAA级企业债等短期债券；
2、债券回购；
3、同业存款；
4、证监会、人民银行等部门批准基金投资的商业票据及其他流动性良好的短期金融工具。

八.基金的投资策略

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地资产配置。

通过对中长期回购利率波动规律的把握对回购资产进行时间方向上的动态配置策略。同时根据回购利差进行回购品种的配置比例调整。同时，把握大盘新股发行、季节因素、日历效应等，捕捉回购利率的高点。对银行间市场和交易所市场出现的跨市场套利机会，进行跨市场套利。对于跨期限套利，进行严格的实证检验，在控制风险的基础上进行操作。在短期债券的个券选择上利用收益率利差策略、收益率曲线策略以及含权债券价值变动策略选择收益高或价值低估的短期债券，进行投资决策。

为控制风险、保证流动性，根据持有人的平均持有期限确定组合的平均持有期限。组合久期控制在180天以内，并通过控制同业存款的比例、保留充足的可变现资产和平均安排回购到期期限，保证基金的高流动性。

本基金的目标资产配置比例如下：

投资品种	计划配置比例
短期债券	20%－95%
债券回购	0%－75%
同业存款／现金	5%－80%

注：市场利率低于同业存款利率时，本基金可将除国债头寸以外的资金全部存放同业

1.投资决策依据

(1)国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定。

(2)宏观经济发展环境、微观企业经济运行态势和证券市场走势。

2.投资决策机制

（1）本基金的投资决策机制为投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

（2）投资决策委员会－负责制定基金投资方面的整体战略和原则；审定基金季度资产配置和调整计划；审定基金季度投资检讨报告；决定基金禁止的投资事项等。

（3）基金经理－负责资产配置、个债配置、投资组合的构建和日常管理。

3.投资决策程序

（1）由基金经理或者组合经理对宏观经济和市场状况进行考察，进行经济与政策研究；

（2）数量化投资部运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对市场预期风险和投资组合风险进行风险测算，并提供分析报告；市场部每日提供基金申购赎回的数据分析报告，供基金经理决策参考；

（3）投资决策委员会进行资产配置政策的设计；投资决策委员会定期召开会议，依据上述报告对资产配置提出指导性意见；如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议做出决策；

（4）结合投资委员会和风险管理委员会的建议，基金经理或者组合经理根据市场状况进行投资组合方案设计；基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，制定资产配置、类属配置和个债配置和调整计划，进行投资组合的构建和日常管理；

（5）进行投资组合的敏感性分析；

（6）对投资方案进行合约性检查，重点检查是否满足基金合同规定和各项法律法规的规定；

（7）基金经理或者组合经理进行投资组合的实施，设定或者调整资产配置比例、单个券种投资比例，交易指令传达到中央交易员；交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，通过交易系统执行投资组合的买卖。交易情况及时反馈到基金经理。

4.投资组合评价

风险控制委员会根据市场变化对投资组合的资产配置和调整提出风险防范建议；风险管理小组对投资组合进行评估，并对风险隐患提出预警；监察部对投资组合的执行过程进行实时风险监控；基金经理依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险。

九.基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准是一年期定期存款利率（税后）。

十.基金的风险收益特征

本基金属低风险低收益产品

十一.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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、收益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取自本基金第四季度报告，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	固定收益投资	25,052,489,770.70	63.21
	其中：债券	25,052,489,770.70	63.21
	资产支持证券	－	－
2	买入返售金融资产	－	－
	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	14,446,937,765.81	36.45
4	其他资产	134,831,614.09	0.34
5	合计	39,634,259,150.60	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	341,792,276,457.59	15.83
	其中：买断式回购融资	－	－
2	报告期末债券回购融资余额	6,019,196,587.20	17.92
	其中：买断式回购融资	－	－

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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例（%）	原因	调整期
1	2008－10－07	23.23	由于当时申购及赎回量巨大，而代销赎回延迟 1 天到账，导致超标。	3个交易日

3、基金投资组合平均剩余期限

（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	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	183
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	112

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
1	2008－11－18	181天	由于一支短期债券到期，导致长期券比重变化，被动超标。	3个交易日

（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	44.57	17.92
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)—60天	0.81	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.36	0.00
3	60天(含)—90天	21.50	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.13	0.00
4	90天(含)—180天	12.36	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.04	0.00
5	180天(含)—397天（含）	38.39	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
	合计	117.63	17.92

4、报告期末债券投资组合

（1）按债券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	17,079,348,895.91	50.86
3	金融债券	2,641,563,132.10	7.87
	其中：政策性金融债	2,136,653,556.63	6.36
4	企业债券	48,066,467.94	0.14
5	企业短期融资券	5,283,511,274.75	15.73
6	其他	－	－
7	合计	25,052,489,770.70	74.60
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	1,186,433,156.06	3.53

（2）报告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

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	0801031	08央行票据31	36,500,000	3,640,501,527.90	10.84
2	0801106	08央行票据106	27,100,000	2,689,961,664.10	8.01
3	0801095	08央行票据95	25,700,000	2,552,693,392.61	7.60
4	0801025	08央行票据25	12,000,000	1,197,916,634.90	3.57
5	0801034	08央行票据34	12,000,000	1,197,071,436.43	3.56
6	0801110	08央行票据110	11,000,000	1,091,212,118.07	3.25
7	0801108	08央行票据108	9,000,000	893,168,037.45	2.66
8	0801064	08央行票据64	8,500,000	846,252,582.55	2.52
9	0801114	08央行票据114	8,000,000	793,291,785.47	2.36
10	0801104	08央行票据104	6,500,000	644,369,051.83	1.92

5、“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	47次
报告期内偏离度的最高值	0.52%
报告期内偏离度的最低值	0.11%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.34%

6、报告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、投资组合报告附注

(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。

(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。

(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。

(4)其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	－
2	应收证券清算款	－
3	应收利息	126,541,911.50
4	应收申购款	8,289,702.59
5	其他应收款	－
6	其他	－
7	合计	134,831,614.09

十二.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。

期　间	①基金收益率	②基金收益率标准差	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率标准差	①－③	②－④
2004.1.16－2004.12.31	2.2053%	0.0014%	1.5568%	0.0002%	0.6485%	0.0012%
2005.1.1－2005.12.31	2.4124%	0.0038%	1.8000%	0.0000%	0.6124%	0.0038%
2006.1.1－2006.12.31	1.9918%	0.0022%	1.8799%	0.0003%	0.1119%	0.0019%
2007.1.1－2007.12.31	2.9637%	0.0036%	2.7850%	0.0019%	0.1787%	0.0017%
2008.1.1－2008.12.31	4.2949%	0.0110%	3.7617%	0.0012%	0.5332%	0.0098%
2004.1.16－2008.12.31	14.6680%	0.0060%	11.7834%	0.0024%	2.8846%	0.0036%

重要说明：本基金采取的收益分配方式是采用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，并以份额形式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。

十三.基金的费用概览

(一)与基金运作有关的费用

与基金运作有关的费用包括：基金管理人的管理费；基金托管人的托管费；基金合同生效后的基金信息披露费用；基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费；基金份额持有人大会费用；基金的证券交易费用；以及其它按照国家有关规定可以在基金资产中列支的其它费用。

1.基金管理人的管理费

基金管理人的管理费以基金资产净值的0.33%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.33%／当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计提，按月支付，由基金托管人于次月前3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

基金托管人的托管费按不高于前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.10%／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

基金托管人的托管费每日计提，按月支付，由基金托管人于次月前3个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

(二)与基金销售有关的费用

1.申购和赎回费

基金	申购费率	赎回费率
现金收益基金	0%	0%

2.转换费用

本基金的转换费用由申购费补差和赎回费补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时的两只基金的申购费率和赎回费率的差异情况而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

3.销售服务费

基金销售人的销售服务费按不高于前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%／当年天数
H为每日应计提的基金销售费
E为前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付，由基金托管人于次月前3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金销售人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

基金管理人可按中国证监会规定程序在基金合同约定的范围内调整申购费率、赎回费率和转换费率，调整后的申购费率和赎回费率和转换费率应在实施前3个工作日内在至少一种指定媒体上公告。

管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等定期或不定期地开展基金促销活动。

(三)其他费用

1.其它与基金运作有关的费用根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

2.基金管理费、托管费和销售服务费的调整

基金管理人、基金托管人和销售人可以协商调低基金管理费、基金托管费和销售服务费，前述费率下调无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

3.基金费用种类的调整

本基金可在中国证监会允许的条件下按照国家的有关规定增加其他种类的基金费用。如本基金仅对新发行的基金单位适用新的基金费用种类，不涉及现有基金份额持有人利益的，无须召开基金份额持有人大会。

十四.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2008年8月30日刊登的本基金原招募说明书(《博时现金收益证券投资基金更新招募说明书摘要》)进行了更新，并根据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

1在“三、基金管理人（一）基金管理人概况”，更新了有关变动人员情况；

2在“四、基金托管人”对托管人情况进行了更新；

3更新了“五、相关服务机构”的相关服务机构的内容；

4更新“八、基金的投资（七）基金投资组合报告”的内容，数据内容截止时间为2008年12月31日；

5更新“九、基金的业绩”数据；

6更新“二十一、其它应披露的事项”内容，披露自2008年7月17日至2009年1月16日期间博时现金收益基金的公告信息，分别是：

（1）2008年7月18日，我公司公告了《博时现金收益证券投资基金季度报告2008年第2号》；

（2）2008年7月31日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于董事会成员任职的公告》；

（3）2008年8月23日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于开通通过中国农业银行借记卡进行直销网上交易定期定额投资业务的公告》；

（4）2008年8月29日，我公司公告了《博时现金收益证券投资基金2008年半年度报告（摘要）》、《博时现金收益证券投资基金2008年半年度报告（正文）》；

（5）2008年8月30日，我公司公告了《博时现金收益证券投资基金更新招募说明书摘要2008年第2号》、《博时现金收益证券投资基金更新招募说明书2008年第2号（正文）》；

（6）2008年9月25日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于博时现金收益证券投资基金“十一”长假前暂停申购及转换转入业务的公告》；

（7）2008年10月10日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于董事长任职的公告》；

（8）2008年10月22日，我公司公告了《博时现金收益证券投资基金2008年度第3季度报告》；

（9）2008年11月12日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于增加浙商银行股份有限公司为代销机构的公告》；

（10）2008年11月14日，我公司公告了《关于博时现金收益证券投资基金偏离度的临时公告》；

（11）2008年11月25日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于增加瑞银证券有限责任公司为代销机构的公告》；

（12）2008年11月28日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于调整博时现金收益证券投资基金大额申购及转换转入业务限额的公告》；

（13）2008年12月11日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于增加上海农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告》；

（14）2008年12月19日，我公司公告了《关于调整博时现金收益证券投资基金大额申购及转换转入业务限额的公告》；

（15）2008年12月26日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于博时现金收益证券投资基金“元旦”长假前暂停申购及转换转入业务的公告》；

（16）2009年1月12日，我公司公告了《关于博时基金管理有限公司在深圳发展银行股份有限公司推出定期定额投资业务的公告》；

（17）2009年1月14日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于博时现金收益证券投资基金恢复大额申购及转换转入业务的公告》。

特此说明

博时基金管理有限公司
2009年3月2日

证券代码：600255　　证券简称：鑫科材料　　编号：临2009—006

安徽鑫科新材料股份有限公司非公开发行限售股份上市流通公告

本公司及其董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

重要内容提示：

1、本次公司非公开发行限售股份上市流通数量为7,900万股

2、本次公司非公开发行限售股份上市流通日为2009年3月5日

一、公司非公开发行股票的相关情况

安徽鑫科新材料股份有限公司（以下简称“本公司”、“公司”或“发行人”）非公开发行股票的方案于2006年10月19日经公司三届十三次董事会审议通过后于2006年11月13日经公司2006年第一次临时股东大会审议通过。

经2007年11月5日公司三届二十次董事会和2007年11月21日公司2007年第二次临时股东大会审议通过，本次非公开发行方案除定价基准日需重新确定外，其它内容不变，有效期自本次股东大会批准后一年内有效。

公司非公开发行A股股票申请于2008年1月4日获得中国证券监督管理委员会发行审核委员会审核有条件通过，2008年1月25日，中国证监会证监许可[2008]147号“《关于核准安徽鑫科新材料股份有限公司非公开发行股票的批复》”核准本公司进行本次非公开发行。

公司于2008年3月5日以非公开发行的方式向10家投资者发行了3,950万股人民币普通股（A股），发行价格为人民币10.96元／股，并在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理了股份登记托管和限售流通手续。根据安徽华普会计师事务所出具的《安徽鑫科新材料股份有限公司验资报告》（华普验字[2008]第198号），本次发行募集资金总额43292万元人民币，扣除发行费用1583.26万元外，募集资金净额41708.74万元。

二、公司非公开发行限售股份上市流通的有关规定

根据《上市公司证券发行管理办法》的有关规定，本次发行对象认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让，锁定期满后将安排其在上海证券交易所上市流通。

三、非公开发行股票发行完成至当前，公司股本的变化情况

自非公开发行股票发行完成至当前，公司于2008年5月9日实施了资本公积金每10股转增10股的2007年度利润分配方案；分配方案完成后，公司总股本由22,475万股增加至44,950万股，其中：公司非公开发行的限售流通股份数量由3,950万股增加至7,900万股。

四、保荐机构核查意见

太平洋证券股份有限公司作为公司本次非公开发行股票的保荐机构，根据《证券法》、《上市公司证券发行管理办法》的有关规定，对公司本次非公开发行对象所持限售股份解除限售事宜进行了核查，并出具核查意见书，其结论如下：鑫科材料非公开发行股份上市流通符合《证券法》、《上市公司证券发行管理办法》、《上市公司非公开发行股票实施细则》、《上海证券交易所股票上市规则》等法律、法规、规则的规定；非公开发行股份持有人均遵守了认购股份时做出的承诺；鑫科材料非公开发行股份限售期满后上市流通不存在实质性障碍，保荐机构同意该部分限售股份上市流通。

五、公司非公开发行限售股份上市流通情况

1、本次公司非公开发行限售股份上市流通数量为7,900万股；

2、本次公司非公开发行限售股份上市流通日为2009年3月5日；

3、本次公司非公开发行限售股份上市流通明细清单

序号	股东名称	持有限售流通股数量（万股）	本次上市数量（万股）	剩余限售流通股数量（万股）
1	无锡市新宝联投资有限公司	2000	2000	0
2	佛山市顺德区濠钢商贸有限公司	1200	1200	0
3	广东鑫鼎投资有限公司	700	700	0
4	张怀斌	700	700	0
5	吕顺发	700	700	0
6	合肥兴泰信托有限责任公司	600	600	0
7	青岛金王集团有限公司	600	600	0
8	上海证券有限责任公司	600	600	0
9	康恩贝集团有限公司	400	400	0
10	吴荣荃	400	400	0
合计		7900	7900	0

六、股本结构变动情况

		本次上市前	变动数	本次上市后
有限售条件的流通股份	1、国家持有股份			
	2、国有法人持有股份			
	3、其他境内法人持有股份	128,182,382	0	128,182,382
	4、境内自然人持有股份			
	5、境外法人、自然人持有股份			
	6、战略投资者配售股份			
	7、一般法人配售股份			
	8、其他	79,000,000	－79,000,000	0
	有限售条件的流通股合计	207,182,382	－79,000,000	128,182,382
无限售条件的流通股份	A股	242,317,618	79,000,000	321,317,618
	B股			
	H股			
	其他			
	无限售条件的流通股份合计	242,317,618	79,000,000	321,317,618
股份总额		449,500,000	0	449,500,000

特此公告。

安徽鑫科新材料股份有限公司董事会
二〇〇九年三月二日

备查文件：

1、公司有限售条件的流通股上市流通申请书；

2、太平洋证券股份有限公司关于安徽鑫科新材料股份有限公司非公开发行股票投资者所持限售股份上市流通的核查报告