

博时现金收益证券投资基金 2009年半年度报告摘要

§1 重要提示及目录

1.1 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的法律责任。

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请仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

2.1 基金基本情况
基金名称：博时现金收益货币
基金代码：050003
基金运作方式：契约型开放式

2.2 基金产品说明
投资目标：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结构的变化，积极主动地在债券资产和货币资产之间进行动态资产配置。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

2.4 信息披露方式
基金管理人的基金管理人互联网网址：http://www.boson.com.cn
基金半年度报告备置地点：基金管理人、基金托管人处

§2 基金简介

2.1 基金基本情况
基金名称：博时现金收益货币
基金代码：050003
基金运作方式：契约型开放式

2.2 基金产品说明
投资目标：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结构的变化，积极主动地在债券资产和货币资产之间进行动态资产配置。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

2.4 信息披露方式
基金管理人的基金管理人互联网网址：http://www.boson.com.cn
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(2009年1月1日至2009年6月30日)

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 业绩比较基准收益率

注：本基金的业绩比较基准是一年期定期存款利率(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约定，自基金合同生效之日起3个月内基金的资产组合比例符合基金合同第十六章(三)投资范围、(八)资产配置策略的有关约定。

§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。

截至报告期末，公司管理资产规模逾1906亿元，共管理理财产品价值增长证券投资基金、博时裕隆证券投资基金、博时现金收益证券投资基金、博时精选股票证券投资基金、博时主题行业股票证券投资基金、博时稳定价值债券投资基金、博时平衡配置合理回报证券投资基金、博时价值增长贰号证券投资基金、博时第三产业成长股票证券投资基金、博时新兴成长股票证券投资基金、博时特选价值股票证券投资基金、博时信用债券投资基金基金共十二只开放式基金和裕隆证券投资基金、裕隆证券投资基金三只封闭式基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金投资管理简介
姓名 职务 任本基金的基金经理日期 证券从业年限 说明

张勇 基金经理 2006-7-1 6年 2001年起先后在南京市商业银行从事支行、南京市商业银行基金管理中心、2003年加入博时公司，历任债券交易员、现金收益基金基金经理兼任债券交易员，现任现金收益基金经理。

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守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律法规、(博时)现金收益证券投资基金合同和其他相关法律法规的规定，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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求长期利益。

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 本基金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
2009年上半年，在政府投资和房地产这两个引擎的带动下，中国经济在全球率先复苏，GDP达到7.1%，“保8”的任务基本已经没有什么悬念。

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守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律法规、(博时)现金收益证券投资基金合同和其他相关法律法规的规定，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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求长期利益。

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 本基金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
2009年上半年，在政府投资和房地产这两个引擎的带动下，中国经济在全球率先复苏，GDP达到7.1%，“保8”的任务基本已经没有什么悬念。

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守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律法规、(博时)现金收益证券投资基金合同和其他相关法律法规的规定，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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求长期利益。

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 本基金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
2009年上半年，在政府投资和房地产这两个引擎的带动下，中国经济在全球率先复苏，GDP达到7.1%，“保8”的任务基本已经没有什么悬念。

2009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 送出日期:2009年8月27日

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：保证基金估值过程的公平、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，当存在异议时，托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释，通过积极磋商达成一致意见。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元固定价格净值支付方式，自基金成立之日起每日将实现的基金净收益分配给基金份额持有人，并按月结转给投资者基金账户，使基金账面份额净值始终保持1.00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
2009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份额持有人利益的行为。

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
2009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份额持有人的行为。根据《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》的规定，托管人发现基金在个别工作日存在以下情况：“债券回购的资金余额超过基金资产净值的20%”以及个别回购指标不符合基金合同的约定。对于上述情况，托管人对基金管理人进行了提示，基金管理人根据规定进行了调整。博时基金管理有限公司在报告期内未发现损害基金份额持有人的行为。

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
2009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的财务指标、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属实、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:2009年6月30日
单位:人民币元

Table with 3 columns: Asset (资产), 2009年6月30日, 2008年12月31日. Rows include 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with 3 columns: Liability (负债), 2009年6月30日, 2008年12月31日. Rows include 短期融资券, 应付债券, 应付管理人报酬, etc.

Table with 3 columns: Net Assets (净资产), 2009年6月30日, 2008年12月31日. Rows include 基金份额持有人权益, 未分配利润, 净资产合计.

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管费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：日托管费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

2009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 送出日期:2009年8月27日

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：保证基金估值过程的公平、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，当存在异议时，托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释，通过积极磋商达成一致意见。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元固定价格净值支付方式，自基金成立之日起每日将实现的基金净收益分配给基金份额持有人，并按月结转给投资者基金账户，使基金账面份额净值始终保持1.00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
2009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份额持有人利益的行为。

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
2009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份额持有人的行为。根据《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》的规定，托管人发现基金在个别工作日存在以下情况：“债券回购的资金余额超过基金资产净值的20%”以及个别回购指标不符合基金合同的约定。对于上述情况，托管人对基金管理人进行了提示，基金管理人根据规定进行了调整。博时基金管理有限公司在报告期内未发现损害基金份额持有人的行为。

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
2009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的财务指标、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属实、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:2009年6月30日
单位:人民币元

Table with 3 columns: Asset (资产), 2009年6月30日, 2008年12月31日. Rows include 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with 3 columns: Liability (负债), 2009年6月30日, 2008年12月31日. Rows include 短期融资券, 应付债券, 应付管理人报酬, etc.

Table with 3 columns: Net Assets (净资产), 2009年6月30日, 2008年12月31日. Rows include 基金份额持有人权益, 未分配利润, 净资产合计.

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

注：支付基金管理人博时基金的托管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。
其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with 2 columns: Item (项目), Deviation (偏离度). Rows include 报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数, 报告期内偏离度的最高值, etc.

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。本基金采用固定价格净值，基金账面份额净值始终保持在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天的浮动损失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 其他资产构成
金额单位:人民币元

Table with 3 columns: Item (序号), Name (名称), Amount (金额). Rows include 1 存在保证金, 2 应收证券清算款, etc.

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
金额单位:份

Table with 5 columns: Category (持有人户数), Sub-category (户均持有的基金份额), Sub-category (机构投资者), Sub-category (个人投资者), Amount (份). Rows include 持有人户数, 机构投资者, etc.

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
金额单位:份

Table with 2 columns: Item (项目), Amount (份). Rows include 基金管理人持有基金份额, 基金托管人持有基金份额.

§9 开放式基金资产变动
单位:份
基金合同生效日(2004年1月16日)基金份额总额 6,285,300,862.26

§10 重大事件提示
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、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 为基金资产提供审计的会计师事务所情况
普华永道会计师事务所为本公司提供审计服务。

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，基金管理人及基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未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
金额单位:人民币元

Table with 6 columns: Name (券商名称), Transaction Type (交易品种), Transaction Amount (成交金额), Proportion (占当期交易总量的比例), Fee (佣金), Proportion (占当期佣金的比例). Rows include 国泰证券, 国元证券, etc.

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》(证监字[2007]48号)的有关法规要求，我公司选择在多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平、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，内部控制健全，在业内有良好的声誉；
(2)具备基金交易所所需的高效、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)具有较强大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，能及时发现并向客户提供高质量的市场分析和行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据我司管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有丰富量化组合策略的能力；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) 基金管理人选择和被选择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超过0.5%的情况。

§11 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2009年6月30日，博时基金公司共管理十二只开放式基金和三只封闭式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理社保基金，以及多个企业年金账户，资产管理总规模逾1906亿元。博时基金公司目前我国资产管理规模最大的基金公司之一，养老金