博时现金收益证券投资基金

更新招募说明书摘要

2007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 2007 年 1 月 16 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2006 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:　吴雄伟
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。公司股东为金信信托投资股份有限公司,持有股份 48%;中国长城资产管理公司,持有股份 25%;招商证券股份有限公司,持有股份 25%;广厦建设集团有限责任公司,持有股份 2%。公司注册资本为 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。

公司下设十三个部门,分别是:市场部、股票投资部、产品规划部、固定收益部、养老金业务部、研究部、交易部、财务部、信息技术部、监察法律部、人力资源部、基金运作部、总裁办公室。市场部从事基金营销策划、渠道沟通、国际业务开发等工作。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。产品规划部负责新产品设计、产品维护和业绩分析等。固定收益部负责进行固定收益证券的选择和组合管理。养老金业务部负责养老金业务的研究、拓展和服务等工作。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。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。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。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。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。另设北京分公司、上海分公司和南方大区,分别负责北方、华东、华中地区和华南地区的基金销售和服务支持工作。此外还建立了企业年金顾问团,负责为客户提供企业年金方案设计方面的顾问服务。

截止到 2006 年 1 月 16 日,总人数 169 人,其中 61.54%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

吴雄伟先生,董事长,博士学历,经济师。历任金信信托投资股份有限公司（原金华信托）总经理办公室主任、研究发展中心主任、总经理助理、基金管理总部总经理、公司副总经理。现任博时基金管理有限公司董事长。

肖风先生,副董事长,博士学历。历任深圳康佳电子集团股份有限公司董事会秘书兼股证委员会主任,中国人民银行深圳经济特区分行证券管理处科长、副处长,深圳市证券管理办公室副处长、处长,证管办副主任。现任博时基金管理有限公司副董事长、总经理。

杨静女士,董事,经济学硕士,高级经济师。1992 年进入证券行业,历任招商银行证券业务部（招商证券前身）总经理助理、招商证券副总裁,先后分管招商证券的经纪、电脑、财务、电子商务、研究等业务工作。现任招商证券副总裁,兼任中国国债协会第二届理事会常务理事,深圳证券业协会常务副理事长。

夏永平女士,董事,经济学硕士,高级经济师。历任中国农业银行总行人事部劳资处主任科员、副处长、处长,中国长城信托投资公司总裁助理、副总裁。现任中国长城资产管理公司工会委员会副主任委员。

汪晓峰先生,董事,经济学学士。曾就职于加拿大多伦多大学亚太经济研究中心;JP 摩根（纽约总部）投资管理研究中心;Dearborn Financial Institute 亚洲区;Pacific World Asset Management Limited 亚太区;香港新鸿基国际有限公司;金信信托投资股份有限公司。

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

王金宝先生,监事,硕士学历。曾任贵州证券公司上海业务部交易部经理、招商证券股份有限公司上海澳门路证券营业部总经理,现任招商证券股份有限公司证券投资部总经理。

包志涛先生,监事,经济学学士,高级经济师。历任中国农业银行信托投资公司业务一部副经理、信托业务部副经理、中国长城信托投资公司资产保全部总经理,现任中国长城资产管理公司债权管理部债权维护处处长。

黄家华先生,监事,商贸学士。历任益高证券及金融有限公司信贷监控员;邓百氏（香港）有限公司市场推广顾问;瑞士丰泰私人金融服务有限公司高级投资顾问;标准人寿亚洲（香港）有限公司高级投资策划顾问;Associe Financiere Global Asset Management Ltd.,行政总监;新鸿基优越理财有限公司董事总经理;金信信托投资股份有限公司董事会风险控制委员会委员。

尹庆军先生,硕士。1991 年 7 月至 1995 年 10 月在中央编译局世界所工作,任助理研究员。1995 年 10 月至 1997 年 7 月在中央编译局办公厅秘书处工作,任科研外事秘书。1997 年 7 月至 1999 年 1 月在中央编译出版社工作,任出版部主任。1999 年 1 月入博时基金管理有限公司,曾任行政管理部人力资源经理,2001 年 3 月起任人力资源部总经理。

3.公司高管人员

吴雄伟先生,董事长,博士学历,经济师。历任金信信托投资股份有限公司（原金华信托）总经理办公室主任、研究发展中心主任、总经理助理、基金管理总部总经理、公司副总经理。现任博时基金管理有限公司董事长。

肖风先生,副董事长兼总经理,博士学历。历任深圳康佳电子集团股份有限公司董事会秘书兼股证委员会主任,中国人民银行深圳经济特区分行证券管理处科长、副处长,深圳市证券管理办公室副处长、处长,证管办副主任。现任博时基金管理有限公司副董事长、总经理。

李全先生,副总经理。1988 年 7 月毕业于中国人民银行总行研究生部。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 年起主管公司运作部门和市场发展部门。李全先生还在新华富时指数委员会担任委员。

4.本基金基金经理

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、高阳、归江、陈亮、唐定中
肖风先生,(同上)
李全先生,(同上)

杨锐先生,1972 年出生,博士。1999 年 7 月毕业于南开大学国际经济研究所,获经济学博士学位。1999 年 8 月入职博时基金管理有限公司,任研究部策略分析师;2002 年 10 月起兼任博时价值增长基金基金经理助理。2004 年 6 月起担任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 月起兼任博时平衡配置基金经理。

高阳先生,硕士。1998 年 6 月毕业于对外经济贸易大学经贸学院。1998 年 7 月至 2000 年 2 月在中国国际金融有限公司销售交易部从事国债投资工作,任经理。2000 年 3 月入博时基金管理有限公司,任基金管理部债券组合投资经理;2001 年 6 月至 2002 年 4 月在英国 BAILLIE GIFFORD 公司接受投资工作培训,并取得英国投资协会颁发的投资管理资格证书（IMC）;2002 年 10 月任博时价值增长证券投资基金基金经理;2003 年 5 月任固定收益部总经理;2004 年 7 月任基金裕泽基金经理;2005 年 8 月起任基金裕隆基金经理。2007 年 1 月起任股票投资部总经理,兼任基金裕隆基金经理。

归江先生,硕士。1998 年 7 月毕业于复旦大学管理学院。1998 年 7 月至 2000 年 3 月于君安证券有限公司证券投资部任投资经理。2000 年 3 月至 2002 年 7 月于国泰君安资产管理部任基金经理。2002 年 8 月入博时基金管理有限公司,任基金管理部基金经理助理;2003 年 6 月起任社保基金基金经理;2005 年 1 月起兼任独立帐户小组主管。

陈亮先生,经济学硕士。1999 年毕业于中国人民大学国民经济学系。1998 年至 2001 年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 月入博时基金管理有限公司,在金融工程小组担任金融工程师;2002 年 9 月任博时价值增长基金经理助理;2003 年 8 月担任博时裕富基金经理;2006 年 8 月任数量化投资小组主管兼博时裕富基金经理;

唐定中先生,硕士。1995 年 7 月毕业于陕西财经学院。1994 年 12 月至 1998 年 8 月,于君安证券有限公司财务部工作,任总经理助理。1998 年 9 月至 2003 年 2 月,于国泰君安证券股份有限公司工作,任一级研究员。2003 年 2 月至 7 月,于民生证券有限公司工作。2003 年 9 月,入职博时基金管理有限公司,任研究部研究员;2004 年 7 月任基金经理助理;2004 年 9 月任社保基金经理。

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:蒋超良
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:458.04 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

（二）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 140 个大中城市设有分支行,全行员工近 6 万人,截至 2005 年末,资产总额为 14234.39 亿元人民币,实现税后利润 92.49 亿元人民币。根据《银行家》杂志最新排名,交通银行按资产总额排名世界 1000 家大银行中第 73 位。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。1998 年被《欧洲货币》评为中国最佳银行,1999 年被《环球金融》评为中国最佳银行,2005 年被《金融亚洲》评为中国最佳银行。

交通银行总行设资产托管部,现有员工 80 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。

（三）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。

阮红女士,交通银行资产托管部总经理,复旦大学企业管理专业博士研究生学历,高级经济师。具有近二十年银行金融从业经验,在银行经营管理方面具有丰富的理论与实践经验。曾任交通银行调研部副主任科员、交通银行办公室秘书处主任科员、交通银行办公室综合处副处长兼宣传处副处长、交通银行办公室综合处处长、交通银行海外机构管理部副总经理、总经理、交通银行上海分行副行长、党委委员,2006 年 1 月至今任交通银行资产托管部总经理。

（四）基金托管业务经营情况

截止 2005 年底,交通银行共托管证券投资基金 31 只,包括普惠基金、安顺基金、汉兴基金、裕华基金、兴科基金、安久基金、科汇基金、科讯基金、久富基金、华安创新基金、科瑞基金、国泰金鹰增长基金、华夏债券基金、湘财合丰系列基金（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、博时现金收益证券投资基金、易方达 50 指数证券投资基金、融通行业景气证券投资基金、鹏华中国 50 开放式证券投资基金、金鹰中小盘精选证券投资基金、富国天益价值证券投资基金、华安宝利证券投资基金、国联优质成长证券投资基金、银河银富货币市场证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、湘财风险预算混合型证券投资基金、万家公用事业证券投资基金等基金,托管了 2 只 QFII 基金——日兴中国人民币国债母基金、日兴 AM 中国人民币 A 股母基金,同时交通银行也是全国社会保障基金两家托管行之一。托管总规模近 1000 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:	吴雄伟
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

名称:	交通银行股份有限公司
住所:	上海市浦东新区银城中路 188 号
法定代表人:	蒋超良
注册日期:	1987年 3 月 30 日
批准设立机关及批准设立文号:	国务院国发（1986）字第 81 号文和中国人民银行银发[1987]40 号文
组织形式:	股份有限公司
注册资本:	458.04 亿元
存续期间:	持续经营
联系人:	张咏东

（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
住所:	上海市浦东新区银城中路 188 号
法定代表人:	蒋超良
电话:	021-58781234
传真:	021-58408842
联系人:	曹榕
客户服务电话:	95559
网址:	www.bankcomm.com

2.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
法定代表人:	郭树清
客户服务电话:	95533
网址:	www.ccb.cn

3.中信银行

名称:	中信银行
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:	010-65543874
传真:	010-65541281
联系人:	文明
客户服务电话:	95558
网址:	www.ecitic.com

4.长江证券有限责任公司

名称:	长江证券有限责任公司
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:	毕艇
电话:	027-65799560
传真:	027-85481532
客户服务电话:	400-8888-999
网址:	www.cz318.com.cn

5.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 26 号
办公地址:	江苏省苏州市石路爱河桥 26 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

6.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

7.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:	上海市浦东新区商城路 618 号
法定代表人:	祝幼一
电话:	021-62580818转 213
传真:	021-52610172
联系人:	芮敏祺
客户服务电话:	400-8888-666
网址:	www.gtja.com

8.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 16-26 层
办公地址:	深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层
法定代表人:	何如
联系人:	林建闽
电话:	0755-82130833转 2181
传真:	0755-82133302
客户服务电话:	800-810-8868
网址:	www.guosen.com.cn

9.海通证券股份有限公司

名称:	海通证券股份有限公司
注册地址:	上海市淮海中路 98 号
办公地址:	上海市淮海中路 98 号
法定代表人:	王开国
联系人:	金芸、杨薇
电话:	021-53858553
传真:	021-53858549
客户服务电话:	400-8888-001
网址:	www.htsec.com

10. 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:	黎晓宏
电话:	010-65183888
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

11. 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:	王政
联系人:	范雪玲
电话:	0755-82492000
传真:	0755-82492187
客户服务电话:	400-8888-555,0755-25125666
网址:	www.lhzq.com

12. 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

13. 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:	0755-82960141
客户服务电话:	4008888111,0755-26951111
网址:	www.newone.com.cn

14. 中国银河证券有限责任公司

名称:	中国银河证券有限责任公司
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:	朱利
电话:	010-66568587
传真:	010-66568536
联系人:	郭京华
客户服务电话:	010-68016655
网址:	www.chinastock.com.cn

15. 光大证券有限责任公司

名称:	光大证券有限责任公司
注册地址:	上海市浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15 楼
法定代表人:	王明权
电话:	021-68816000
传真:	021-68815009
联系人:	刘晨
客户服务电话:	021-68816770
网址:	www.ebscn.com

16. 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:	陈海晓
联系人:	叶毓蔚、张帆
电话:	0571-87828088
传真:	0571-87922522
客户服务电话:	0571-96597,96336
网址:	www.ctsec.com

17. 深圳发展银行

名称:	深圳发展银行
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

18. 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:	陈伟、杜颖灏
电话:	021-68634518
传真:	021-68865938
客户服务电话:	021-68865020
网址:	www.xcsc.com;www.eestart.com

19. 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:	上海市浦东大道 720 号 20 楼
办公地址:	上海市浦东大道 720 号 20 楼
法定代表人:	王益民
联系人:	盛云
电话:	021-50367888
传真:	021-50366868
客户服务电话:	021-962506
网址:	www.dfzq.com.cn

20. 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:	宁金彪
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

21. 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
法定代表人:	陈唯贤
联系人:	何博远
电话:	0571-87902760
传真:	0571-87901946
客户服务电话:	0571-87901931
网址:	www.stocke.com.cn

22. 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:	叶黎成
联系人:	余江 庄维佳
电话:	0755-82450826 22622287
传真:	0755-82433794
客户服务电话:	95511
网址:	www.pa18.com

23. 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 – 83199599
传真:	0755 – 83199545
联系人:	章磊 刘军辉
客户服务电话:	0755-83199511
网址:	www.csco.com.cn

24. 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:	0755-83025430
传真:	0755-83025991
联系人:	杨玲
客户服务电话:	4008-888-818
网址:	www.hx168.com.cn

26、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:	谢平
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

27、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

28、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

（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、刘伟宁

（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:	汪棣、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

25. 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;
26. 债券回购;
27. 同业存款;
28. 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（扣除 20%的利息税）。从 2004 年 1 月 16 日至 2004 年 10 月 28 日的业绩比较基准为年利率 1.58%（税后）;因央行调息,从 2004 年 10 月 29 日起,业绩比较基准调整为年利率 1.80%（税后）。因央行体调息,从 2006 年 8 月 19 日起,业绩比较基准调整为年利率 2.02%（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,于 2007 年 2 月 28 日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现金收益证券投资基金第四季度报告,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

资产组合	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
债券投资	4,186,896,423.90	95.67
买入返售证券	0.00	0.00
其中:买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00
银行存款和清算备付金合计	152,564,802.95	3.49
其他资产	37,001,155.04	0.84
合计	4,376,462,381.89	100.00

2. 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	73,962,590,000.00	17.00
	其中:买断式回购融入的资金	0.00	0.00
2	报告期末债券回购融资余额	530,400,000.00	13.80
	其中:买断式回购融入的资金	0.00	0.00

在本报告期内,本基金债券正回购的资金余额存在超过基金资产净值的 20%的情况。具体如下表:

序号	发生日期	比例（%）	原因	调整期
1	2006-10-31	20.84	月底大额赎回,被动超标	1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	173
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	179
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	99

报告期内投资组合平均剩余期限没有超过 180 天的情况。

(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	6.57%	13.80%
2	30天（含）– 60 天	4.19%	0.00%
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.33%	0.00%
3	60天（含）– 90 天	11.43%	0.00%
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	9.38%	0.00%
4	90天（含）– 180 天	37.62%	0.00%
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	6.61%	0.00%
5	180天（含）– 397 天（含）	53.13%	0.00%
合　计		112.94%	13.80%

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	成本（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	国家债券	0.00	0.00%
2	金融债券	1,313,627,215.42	34.19%
	其中:政策性金融债	988,569,501.02	25.73%
3	央行票据	862,313,210.05	22.44%
4	企业债券	2,010,955,998.43	52.34%
5	其他	0.00	0.00%
合　计		4,149,596,268.68	108.97%
剩余期限超过 397 天的浮动利率债券		665,416,700.43	17.32%

(2) 基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量		成本（元）	占基金资产净值的比例（%）
		自有投资	买断式回购		
1	06央行票据 78	5,000,000	0	489,180,589.01	12.73%
2	06农发 02	2,100,000	0	209,641,599.90	5.46%
3	04建行 03	2,000,000	0	204,145,141.75	5.31%
4	06农发 08	2,000,000	0	199,993,207.76	5.21%
5	04国开 20	2,000,000	0	199,298,588.46	5.19%
6	06央行票据 64	2,000,000	0	196,317,558.98	5.11%
7	06北钢 CP01	1,400,000	0	137,189,537.10	3.57%
8	05中行 02	1,200,000	0	120,912,572.65	3.15%
9	06酒钢 CP01	1,200,000	0	120,114,555.83	3.13%
10	06沙钢 CP01	1,200,000	0	117,945,777.91	3.07%

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	偏离程度
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	0.24%
报告期内偏离度的最低值	0.01%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.12%

6. 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,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。本基金采用固定单位净值,基金账面单位净值始终保持 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、处罚的。

(4) 其他资产的构成

序号	其他资产	金额（元）
1	交易保证金	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	21,839,014.24
4	应收申购款	15,162,140.80
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	0.00
7	其他	0.00
合　计		37,001,155.04

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
过去三个月	0.5096%	0.0008%	0.5081%	0.0000%	0.0015%	0.0008%
过去六个月	1.0331%	0.0019%	0.9873%	0.0003%	0.0458%	0.0016%
过去一年	1.9918%	0.0022%	1.8799%	0.0003%	0.1119%	0.0019%
自基金合同生效起至今	6.7812%	0.0027%	5.2367%	0.0004%	1.5445%	0.0023%

重要说明:本基金采取的收益分配方式是采用 1.00 元固定单位净值交易方式,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,使基金账面单位净值始终保持 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。

4. 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。

5. 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 2006 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、（二）主要成员情况 1、基金管理人董事会成员 3、公司高管人员、4、本基金基金经理 5、投资决策委员会成员”中,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,其中原北京证券合并到了招商证券股份有限公司,原天和证券经纪有限责任公司更名为“财通证券经纪有限责任公司”,原金信证券更名为“浙商证券有限责任公司”;增加代销机构“招商银行股份有限公司”;

4 更新了“三、（七）会计师事务所”的部分信息;

5 更新“七、基金的申购与赎回和转换（五）基金申购和赎回的数额限定”;

6 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 2006 年 12 月 31 日;

7 更新“九、基金的业绩”数据;

8 更新“二十一、其它应披露的事项”内容,披露自 2006 年 7 月 16 日至 2007 年 1 月 16 日期间博时现金收益基金的公告信息,分别是:

(1) 2006 年 7 月 18 日,基金托管人在《证券时报》上刊登了《关于交通银行股份有限公司住所变更的公告》;
(2) 2006 年 7 月 21 日,我公司公告了《博时现金收益证券投资基金季度报告 2006 年第 2 号》;
(3) 2006 年 7 月 26 日,我公司公告了《博时基金管理有限公司关于调整所管理开放式基金交易限额的公告》;
(4) 2006 年 8 月 17 日,我公司公告了《博时基金管理有限公司关于增加开放式基金代销机构的公告》;
(5) 2006 年 8 月 28 日,我公司公告了《博时现金收益证券投资基金 2006 年半年度报告（摘要）》;
(6) 2006 年 8 月 28 日,我公司公告了《博时现金收益证券投资基金 2006 年半年度报告》;
(7) 2006 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 2006 年第 2 号》;
(8) 2006 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 2006 年第 2 号》;
(9) 2006 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”长假前限制申购及基金交易提示的公告》;
(10)2006 年 10 月 26 日,我公司公告了《博时现金收益证券投资基金季度报告 2006 年第 3 号》;
(11)2006 年 12 月 8 日,我公司公告了《博时基金管理有限公司关于基金代销机构天和证券变更为财通证券的公告》;
(12)2006 年 12 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 2007 年“元旦”长假前限制申购及基金交易提示的公告》

博时基金管理有限公司
2007 年 3 月 2 日

权证代码:580996　　权证简称:沪场 JTP1　　公告编号:2007 权 04

上海机场(集团)有限公司关于“沪场 JTP1”认沽权证行权特别提示性公告

鉴于“沪场 JTP1”认沽权证到期日将近,现特提请投资者认真关注“沪场 JTP1”认沽权证行权的有关问题和投资风险。

1、“沪场 JTP1”认沽权证存续期为 2006 年 3 月 7 日至 2007 年 3 月 6 日,共计 12 个月。

2、根据《上海证券交易所权证管理暂行办法》的有关规定,权证存续期满前 5 个交易日终止交易。“沪场 JTP1”认沽权证的最后交易日为 2007 年 2 月 27 日（星期二）,已于 2007 年 2 月 28 日（星期三）起停止交易。

3、“沪场 JTP1”认沽权证的行权期限为认沽权证存续期最后 1 日（即 2007 年 3 月 6 日）的交易所交易时间。

4、“沪场 JTP1”认沽权证经分红除息调整后的行权价格为 13.36 元,投资者每持有一份“沪场 JTP1”认沽权证,有权在行权期限内以 13.36 元价格向上海机场集团卖出一份“上海机场”股票,成功行权获得的资金在次交易日可使用。

5、截止“沪场 JTP1”认沽权证的行权终止日,尚未行权的“沪场 JTP1”认沽权证将予以注销。

6、“沪场 JTP1”认沽权证行权申报要素:

行权代码:582996
买卖方向:买入
申报价格:13.36 元 / 股
申报数量不得大于持有的权证份数,而且有足额的“上海机场”股票进行行权。

7、“沪场 JTP1”认沽权证行权的申报数量为 1 份的整数倍。

鉴于本次公告日起距“沪场 JTP1”认沽权证行权日仅为 3 个交易日,本公告日前一交易日“上海机场”正股收盘价为 24.39 元,“沪场 JTP1”认沽权证最后交易日的收盘价为 0.015 元,“沪场 JTP1”认沽权证的行权价格为 13.36 元,特提请投资者注意相关投资风险。

若有疑问,请拨行权热线电话 021-50554618 转 8634、021-68341609。

特此公告。

上海机场(集团)有限公司
2007 年 3 月 2 日

证券代码:600733　　股票简称:S 前锋　　编号:临 2007-016

成都前锋电子股份有限公司关于资产置换及吸收合并事宜的债权人公告

本公司及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、误导性陈述或重大遗漏负连带责任。

成都前锋电子股份有限公司(下称 " 本公司 ") 2007 年度第二次临时股东大会审议通过了与北京首都创业集团有限公司（以下简称:首创集团）进行资产置换及以新增股份吸收合并首创证券有限责任公司（以下简称:首创证券）的议案,本公司以公司全部资产与首创集团以其所拥有的首创证券的 11.6337%的股权及现金 6117.79 万元进行置换,同时以新增股份吸收合并首创证券,承继及承接首创证券的所有资产、负债、业务及员工等。首创证券作为被合并方,在合并完成后不经过清算程序予以注销,首创证券的债权债务由合并后的本公司承继。

上述资产置换及吸收合并方案尚需获得本公司股权分置改革相关股东会议审议通过本公司股权分置改革方案及中国证券监督管理委员会的批准后方可实施。

根据《中华人民共和国公司法》的相关规定,凡本公司债权人均可于本公告首次刊登之日（2007 年 3 月 2 日）起依法向本公司申报债权,并据有效债权文件及凭证向本公司要求清偿债务或者要求提供担保。

申报债权的方式如下:

(1)以邮寄方式申报的,请向以下地址寄送其债权资料:成都市武侯区人民南路四段 1 号,邮政编码:610041,请在邮件封面上注明 " 申报债权 " 的字样;

(2)联系方式:
联系人:王小平
联系电话:028-86316795

特此公告。

成都前锋电子股份有限公司
二 OO 七年三月一日