

博时现金收益证券投资基金 2007年半年度报告摘要

重要提示
本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...

一、基金简介
(一)基金名称:博时现金
(二)基金代码:050003
基金运作方式:契约型、开放式

基金合同生效日(基金成立日):2004年1月16日
报告期末基金份额总额:3,102,801,424.63份
(二)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资产配置。

业绩比较基准:一年期定期存款利率(税后)
风险收益特征:现金收益证券投资基金投资于短期资本市场基础工具,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。

(三)基金管理人名称:博时基金管理有限公司
信息披露负责人:孙麒麟
联系电话:0755-83169999

电子信箱:servico@bosera.com
(四)基金托管人名称:交通银行股份有限公司
信息披露负责人:张咏东

二、主要财务指标和基金收益表现
(一)主要财务指标
2007年上半年度主要财务指标

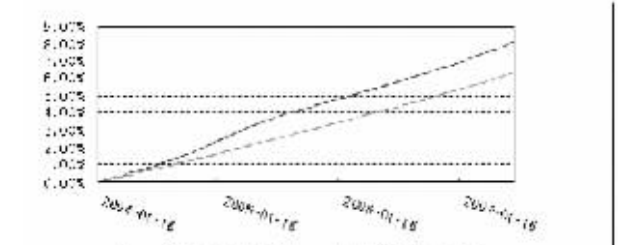
Table with 2 columns: 主要财务指标, 本报告期财务指标. Rows include 基金本期净收益, 期末基金资产净值, etc.

上述财务指标采用的计算公式,详见中国证券监督管理委员会发布的证券投资基金信息披露编报规则第5号《货币市场基金信息披露特别规定》。

(二)基金收益表现
1. 历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 6 columns: 阶段, ①基金净收益率, ②业绩比较基准收益率, ③业绩比较基准差率, ④-⑥. Rows show data for 过去一个月, 过去两个月, etc.

2. 自基金合同生效以来基金收益的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较



3. 本基金业绩比较基准的构建以及再平衡过程
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)...

三、管理人报告
(一)基金管理人及基金经理简介

1. 基金管理人简介
博时基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会证监基金字[1998]26号文批准设立...

2. 基金经理简介
张勇先生,学士。2001年毕业于南京审计学院金融学专业,获学士学位。

(二)本报告期内基金运作情况说明
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》及其各项实施细则...

(三)本报告期内基金的投资策略和业绩表现
1. 行情回顾
上半年经济总体偏热,通胀压力较大。1-5月份固定资产投资增长率呈现出高位窄幅振荡的趋势...

2. 投资思路
投资品种方面,我们逐步降低了金融债的投资比例,根据资金供求变化,用流动性较高的央行票据或收益率较高的短期融资券进行替代。

3. 市场发展及投资策略
首先,特别国债的发行将挤占央票发行量,减少央票供给,预计1年期央票发行利率在央行的控制下仍波动较少...

其次,从资金面来看,下半年到期央票1.4万亿元,1.55万亿元的特别国债与到期央票数量基本持平,预计下半年新增外汇占款1.3万亿元...

第三,从市场来看,下半年到期央票1.4万亿元,1.55万亿元的特别国债与到期央票数量基本持平,预计下半年新增外汇占款1.3万亿元...

第四,从市场来看,下半年到期央票1.4万亿元,1.55万亿元的特别国债与到期央票数量基本持平,预计下半年新增外汇占款1.3万亿元...

第五,从市场来看,下半年到期央票1.4万亿元,1.55万亿元的特别国债与到期央票数量基本持平,预计下半年新增外汇占款1.3万亿元...

第六,从市场来看,下半年到期央票1.4万亿元,1.55万亿元的特别国债与到期央票数量基本持平,预计下半年新增外汇占款1.3万亿元...

第七,从市场来看,下半年到期央票1.4万亿元,1.55万亿元的特别国债与到期央票数量基本持平,预计下半年新增外汇占款1.3万亿元...

第八,从市场来看,下半年到期央票1.4万亿元,1.55万亿元的特别国债与到期央票数量基本持平,预计下半年新增外汇占款1.3万亿元...

弥补了央票供给的不足,短端收益率不会大幅提高。

第三,短期融资券发行趋缓,主体信用评级的引入使定价分歧减小,信用利差有所下降,仍可成为我们下半年的重点投资品种。

第四,通胀压力不容小觑,3季度CPI突破4%的可能性较大,加息预期仍然较强,我们会谨慎关注未来经济数据走势;股市对资金的分流作用还将引起资金面的剧烈波动...

四、托管人报告
2007年上半年,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...

2007年上半年,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、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持有人利益的行为。

五、财务会计报告
(一)基金半年度会计报表(未经审计)
1. 博时现金收益证券投资基金资产负债表

Table with 3 columns: 资产, 2007年6月30日, 2006年12月31日. Rows include 银行存款, 清算备付金, 应收利息, etc.

Table with 3 columns: 负债, 2007年6月30日, 2006年12月31日. Rows include 应付证券清算款, 应付管理人报酬, 应付托管费, etc.

Table with 3 columns: 持有人权益, 2007年6月30日, 2006年12月31日. Rows include 实收基金, 未分配基金持有人权益总计.

Table with 3 columns: 收入, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 债券利息收入, 债券投资收益, etc.

Table with 3 columns: 费用, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 基金管理人报酬, 基金托管费, 销售服务费, etc.

Table with 3 columns: 基金净收益及基金净值变动, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 基金净收入, 加:前期基金净收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 期初基金净值, 本期基金净收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 期初基金净值, 本期基金净收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 期初基金净值, 本期基金净收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 期初基金净值, 本期基金净收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 期初基金净值, 本期基金净收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 期初基金净值, 本期基金净收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 期初基金净值, 本期基金净收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 期初基金净值, 本期基金净收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 期初基金净值, 本期基金净收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 期初基金净值, 本期基金净收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 期初基金净值, 本期基金净收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 期初基金净值, 本期基金净收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 期初基金净值, 本期基金净收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 期初基金净值, 本期基金净收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 期初基金净值, 本期基金净收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 期初基金净值, 本期基金净收益, etc.

Table with 3 columns: 项目, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 期初基金净值, 本期基金净收益, etc.

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率,在证券持有期内采用直线法逐日计提。

(g) 费用的确认和计量
本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率逐日计提。本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率,在回购期限内采用直线法逐日计提。

(h) 实收基金
实收基金为对外发行的基金份额总额,每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

(i) 基金的收益分配政策
每一基金份额享有同等分配权。当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益;当日赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金的分配权益。

(j) 重大关联方关系及关联交易
(1) 关联方名称
博时基金管理有限公司

与本基金的关系
基金管理人、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
金信信托投资股份有限公司(“金信”)基金管理人、基金代销机构

(k) 基金管理人报酬
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。

(l) 基金销售服务费
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0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给基金销售机构。

(m) 基金托管费
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。

(n) 基金销售服务费
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。

Table with 3 columns: 关联方名称, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 交通银行股份有限公司, 招商证券股份有限公司, etc.

(o) 关联方为保管的银行存款余额及由此产生的利息收入
本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管,并按银行间同业利率计息。

(p) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易
本基金在本会计期间未与基金托管人交通银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下:

Table with 3 columns: 关联方名称, 2007年1月1日至2007年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间. Rows include 买入债券结算金额, 卖出债券结算金额.

Table with 3 columns: 基金资产净值, 2007年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 基金份额(份), 基金份额净值, etc.

3. 流通受限不能自由转让的基金资产
本基金截至2007年6月30日止,系银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券余额606,760,000.00元,系以下债券作为抵押:

Table with 5 columns: 债券代码, 债券名称, 回购到期日, 期末余额占本单比例, 数量(张), 期末摊余成本(元). Rows include 070102, 070106, etc.

Table with 3 columns: 资产净值, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 债券投资, 买入返售证券, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 报告期内债券回购融资余额, 其中:深交所质押融入的资金, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 报告期内债券回购融资余额, 其中:深交所质押融入的资金, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 报告期内债券回购融资余额, 其中:深交所质押融入的资金, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 报告期内债券回购融资余额, 其中:深交所质押融入的资金, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 报告期内债券回购融资余额, 其中:深交所质押融入的资金, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 报告期内债券回购融资余额, 其中:深交所质押融入的资金, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 报告期内债券回购融资余额, 其中:深交所质押融入的资金, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 报告期内债券回购融资余额, 其中:深交所质押融入的资金, etc.

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 成本(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 国债债券, 2 金融债券, etc.

Table with 3 columns: 序号, 债券名称, 金额(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 04债行03序, 2 06央行票据70, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.

Table with 3 columns: 项目, 金额(元), 偏离程度. Rows include 报告期内偏离度绝对值在0.25%(含)-0.5%区间次数, 报告期内偏离度最高值, etc.