博时现金收益证券投资基金

【2012】半年度报告摘要

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：２０１２年８月２５日

§１重要提示

基金管理人的董事会、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。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2012年8月24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2012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

基金名称	博时现金收益证券投资基金
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	29,903,272,520.33份
基金合同存续期	不定期

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	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(2012年1月1日至2012年6月30日)
本期已实现收益	790,135,138.16
本期利润	790,135,138.16
本期净值收益率	2.46%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末基金资产净值	29,903,272,520.33
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

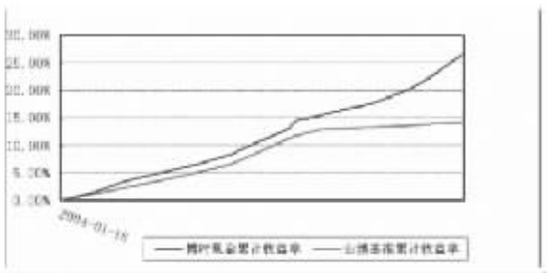
3.2.1基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.3999%	0.0116%	0.0353%	0.0001%	0.3646%	0.0115%
过去三个月	1.1876%	0.0085%	0.1200%	0.0001%	1.0676%	0.0084%
过去六个月	2.4630%	0.0067%	0.2450%	0.0001%	2.2180%	0.0066%
过去一年	4.8477%	0.0048%	0.5006%	0.0001%	4.3471%	0.0047%
过去三年	9.8396%	0.0075%	1.2702%	0.0002%	8.5694%	0.0073%
自基金成立起至今	26.7953%	0.0065%	14.1693%	0.0032%	12.6260%	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（二）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、郑州、沈阳、成都设有分公司，此外，还设有海外子公司：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2012年6月30日，博时基金公司共管理三十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，公募基金资产规模逾1194亿元人民币，累计分红570.26亿元人民币，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2012年6月29日，开放式基金中，博时超大盘ETF及超大盘ETF联接基金上半年收益率在同类型115只基金中分列第二和第四；另外，博时主题行业基金、博时创业成长基金、博时裕祥分级债A类、博时信用债A/B类的上半年收益率都进入了同类型基金的前30%。封闭式基金中，基金裕隆上半年收益率在同类的25只基金中排名第三。

2、客户服务

2012年1月至6月，博时基金共举办各类渠道培训活动共计83场；"博时e视界"共举办视频直播活动23场，在线人数累计2164人次；1月5日举办"2012博时基金投资策略媒体交流会"，到会50多家媒体。1月6日在中华世纪坛举办"博时基金投资论坛暨2012投资策略交流会"，到会约220名机构和零售高端客户，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）6月28日，世界品牌实验室（WBL）在京发布2012年（第九届）《中国500最具价值品牌》排行榜，博时基金以61.92亿元的品牌价值位列第220名，成为入选该榜单四家基金公司中的第一名。

2）2012年5月25日，在由21世纪经济报道主办的"2011年度赢基金奖"评选中，博时基金荣获"2011年度中国最佳基金公司"奖项。

3）2012年4月20日，由上海证券报社主办的第九届中国"金基金"奖评选揭晓，博时基金管理有限公司获得2011年度"金基金？TOP公司奖"，博时主题行业股票基金获得2011年度"五年期金基金•股票型基金奖"，博时价值增长混合基金获得2011年度"一年期金基金？偏股混合型基金奖"。

4）3月28日，由理财周报主办的"2012中国金融品牌管理者年会暨2011中国金融品牌『金象奖』颁奖典礼"在京举行。"博时抗通胀增强回报基金"营销事件荣获2011中国金融品牌『金象奖』之"2011中国金融品牌年度十大营销事件"。

5）3月28日，中证报"2012年金牛基金论坛暨第九届中国基金业金牛奖颁奖盛典"在京举行。博时基金荣膺六项大奖，分别是：博时基金管理有限公司荣获"金牛基金管理公司"、博时裕隆封闭荣获"五年期封闭式金牛基金"、博时主题行业荣获"五年期股票型金牛基金"、博时第三产业荣获"2011年度股票型金牛基金"、博时特许价值荣获"2011年度股票型金牛基金"、博时价值增长荣获"2011年度混合型金牛基金"。

6）3月26日，在"晨星2012年度基金奖"中，我司旗下两只产品获得提名：博时主题行业股票基金获得"晨星2012年度股票型基金奖"提名、博时价值增长混合基金获得"晨星2012年度混合型基金奖"提名。

7）3月26日，在"证券时报2011年度中国基金业明星奖"中，我司共获得七项大奖：博时基金管理有限公司获得"2011年度十大明星基金公司奖"、博时特许价值股票基金获得"三年持续回报股票型明星基金奖"、博时主题行业股票基金和博时特许价值股票基金获得"2011年度股票型明星基金奖"、博时价值增长基金和博时价值增长贰号基金获得"2011年度平衡混合型明星基金奖"、博时裕隆封闭获得"2011年度封闭式明星基金奖"。

4、其他大事件

1）博时标普500指数型证券投资基金首募顺利结束并于6月14日正式成立。

2）博时于5月15日开通支付宝支付渠道，成为首家在直销网上交易中引入支付宝渠道的基金公司。

3）博时上证自然资源ETF于5月11日起在上证所上市，交易代码为510410，日常申购、赎回业务也同步开放。

4）博时天颐债券型证券投资基金首募顺利结束并于2月29日正式成立。

5）上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金及联接基金于2012年3月5日至3月30日完成了首次募集。

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	固定收益部副总经理/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、现任固定收益部副总经理/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。

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，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

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 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

2012年上半年，国内经济增长同比下滑。稳增长政策连续推出，信贷投放温和扩张，通胀水平连续下降。

回顾上半年债券市场，利率产品收益率稳中有降，尤其是短期品种，收益下降明显。信用产品收益整体大幅下降，中低评级品种收益下降尤为明显。回购利率持续下降，资金面整体宽松。

在稳增长的大背景下，货币市场利率持续下降是大概率事件。年初加大投资力度，各品种均衡投资；进入二季度，收益率整体大幅下行，谨慎操作。在规模大幅增长前提下，定存是我们主要投资品种。而短融收益进入一个相对较低的位置后，我们选择了减少投资。

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2.46%，业绩基准增长率为0.25%。

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，稳增长政策力度或将有所加大，政府投资也是其中重点，经济企稳及小幅回升是大概率事件。货币市场利率或将维持低位，信用产品在经过上半年大幅上升后，或将有所回调。

我们将紧盯政策调整节奏，适时调整组合结构。如果信用产品出现调整，我们将加大该品种投资；减少利率品种投资。

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790，135，138.16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

2012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

2012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持有人利益的行为。个别工作日，托管人发现个别监督指标不符合基金合同的约定，托管人及时通知了基金管理人，基金管理人根据规定进行了调整。本基金本报告期内向份额持有人分配利润：790，135，138.16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

2012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：2012年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资产：		
银行存款	21,680,968,962.56	12,701,108,346.77
结算备付金	5,636,363.64	32,733,560.49
存出保证金	-	-
交易性金融资产	12,075,564,848.86	11,449,270,627.01
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	12,075,564,848.86	11,449,270,627.01
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	1,719,002,475.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	567,314,022.48	248,547,545.30
应收股利	-	-
应收申购款	106,320,824.47	9,473,489.06
递延所得税资产	-	-
其他资产	45,000.00	45,000.00
资产总计	34,435,850,022.01	26,160,181,043.63
负债和所有者权益	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011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	4,502,995,148.50	3,646,583,215.11
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	11,097,869.89	6,986,577.38
应付托管费	3,362,990.89	2,117,144.66
应付销售服务费	8,407,477.21	5,292,861.65
应付交易费用	93,232.48	171,742.99
应交税费	2,211,508.02	2,041,018.51
应付利息	902,479.28	1,119,887.74
应付利润	3,288,994.19	2,929,230.34
递延所得税负债	-	-
其他负债	217,801.22	320,000.00
负债合计	4,532,577,501.68	3,667,561,678.38
所有者权益：		
实收基金	29,903,272,520.33	22,492,619,365.25
未分配利润	-	-
所有者权益合计	29,903,272,520.33	22,492,619,365.25
负债和所有者权益总计	34,435,850,022.01	26,160,181,043.63

注：报告截止日2012年6月30日，基金份额净值1.0000 元，基金份额总额29，903，272，520.33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：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

资产	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
一、收入	937,741,570.76	113,456,111.56
1.利息收入	860,319,772.40	106,346,397.97
其中：存款利息收入	531,048,790.62	31,273,242.61
债券利息收入	313,771,675.49	55,822,216.01
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	15,499,306.29	19,250,939.35
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	77,421,798.36	7,099,713.59
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	77,421,798.36	7,099,713.59
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	147,606,432.60	25,603,224.38
1.管理人报酬	54,135,838.18	9,340,927.40
2.托管费	16,404,799.47	2,830,584.12
3.销售服务费	41,011,998.67	7,076,460.16
4.交易费用	900.00	-
5.利息支出	35,750,028.71	6,106,876.19
其中：卖出回购金融资产支出	35,750,028.71	6,106,876.19
6.其他费用	302,867.57	248,376.51
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	790,135,138.16	87,852,887.18
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	790,135,138.16	87,852,887.18

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：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	22,492,619,365.25	-	22,492,619,365.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	790,135,138.16	790,135,138.16
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）	7,410,653,155.08	-	7,410,653,155.08
其中：1.基金申购款	97,318,682,975.97	-	97,318,682,975.97
2.基金赎回款	-89,908,029,820.89	-	-89,908,029,820.89
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)	-	-790,135,138.16	-790,135,138.16
五、期末所有者权益(基金净值)	29,903,272,520.33	-	29,903,272,520.33
项目	上年度可比期间 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

报表附注为财务报表的组成部分。

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：何宝　　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

注：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

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 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	54,135,838.18	9,340,927.40
其中：支付销售机构的客户维护费	10,442,862.88	1,065,257.79

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 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	16,404,799.47	2,830,584.12

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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期2012年1月1日至2012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	8,147,379.96
交通银行	1,715,054.27
招商证券	246,259.94
合计	10,108,694.17
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2011年1月1日至2011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	3,267,142.52
交通银行	261,701.93
招商证券	68,157.13
合计	3,597,001.58

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

本期 2012年1月1日至2012年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	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	535,802,778.99	955,933,726.03			41,879,000,000.00	8,694,292.70
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	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

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

无。

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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
交通银行活期存款	30,968,962.56	108,532.53	6,013,550.63	70,601.59
交通银行定期存款	10,900,000,000.00	245,779,062.33	-	-

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2012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（2011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

金额单位：人民币元

本期2012年1月1日至2012年6月30日					
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	
				数量(单位：张)	总金额
招商证券	41259005	12厦钨CP001	簿记建档集中配售	300,000	30,000,000.00
招商证券、交通银行	41251015	12铁道CP001	簿记建档集中配售	20,000,000	2,000,000,000.00
交通银行	11207001	12南电SCP001	簿记建档集中配售	2,000,000	200,000,000.00
交通银行	41254005	12长电CP001	簿记建档集中配售	100,000	10,000,000.00
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日					
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	
				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
招商证券	1181089	11美邦CP01	簿记建档集中配售	200,000	20,000,000.00

6.4.4期末"2012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2012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4，502，995，148.50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
1101088	11央行票据88	2012-7-2	99.01	7,000,000	693,070,000.00
120218	12国开18	2012-7-2	100.44	3,400,000	341,496,000.00
120305	12进出05	2012-7-2	100.45	3,000,000	301,350,000.00
120405	12农发05	2012-7-2	100.47	2,500,000	251,175,000.00
041173001	11中冶CP003	2012-7-2	101.60	2,400,000	243,840,000.00
0980147	09中航工债浮	2012-7-2	104.33	2,000,000	208,660,000.00
011207001	12南电SCP001	2012-7-2	99.84	2,000,000	199,680,000.00
041159001	11首旅CP001	2012-7-2	101.41	1,600,000	162,256,000.00
041161016	11万向CP001	2012-7-2	101.93	1,500,000	152,895,000.00
041158016	11广汇汽车CP001	2012-7-2	101.81	1,500,000	152,715,000.00
090217	09国开17	2012-7-2	100.05	1,000,000	100,050,000.00
1101082	11央行票据82	2012-7-2	99.16	1,000,000	99,160,000.00
1181325	11荣盛CP02	2012-7-2	101.16	900,000	91,044,000.00
080405	08农发05	2012-7-2	101.23	800,000	80,984,000.00
041161006	11桂冠CP002	2012-7-2	101.73	600,000	61,038,000.00
041260019	12中金集CP001	2012-7-2	100.83	600,000	60,498,000.00
041152013	11正泰CP002	2012-7-2	101.94	500,000	50,970,000.00
041158013	11皖交投CP002	2012-7-2	101.84	500,000	50,920,000.00
1181352	11韵升CP01	2012-7-2	101.51	500,000	50,755,000.00
1181363	11云内CP01	2012-7-2	101.43	500,000	50,715,000.00
1181364	11沈化工CP01	2012-7-2	101.43	500,000	50,715,000.00
041151007	11中铁建CP001	2012-7-2	101.38	500,000	50,690,000.00
041159018	11南车CP002	2012-7-2	101.36	500,000	50,680,000.00
1181378	11龙煤CP01	2012-7-2	101.32	500,000	50,660,000.00
1181313	11韶能CP01	2012-7-2	101.19	500,000	50,595,000.00
110307	11进出07	2012-7-2	100.70	500,000	50,350,000.00
070219	07国开19	2012-7-2	100.30	500,000	50,150,000.00
110242	11国开42	2012-7-2	100.06	500,000	50,030,000.00
058031	05中信债1	2012-7-2	99.34	500,000	49,670,000.00
1181383	11浙农资CP02	2012-7-2	101.62	400,000	40,648,000.00
1181369	11宏图CP02	2012-7-2	101.53	400,000	40,612,000.00
1181360	11亨通CP01	2012-7-2	101.49	400,000	40,596,000.00
1181316	11晶科CP03	2012-7-2	101.28	400,000	40,512,000.00
041152012	11大唐CP002	2012-7-2	101.27	400,000	40,508,000.00
041156010	11国开投CP001	2012-7-2	101.26	400,000	40,504,000.00
041156013	11电网CP002	2012-7-2	101.17	400,000	40,468,000.00
1181395	11鹏博士CP01	2012-7-2	99.00	400,000	39,600,000.00
041260006	12昊融CP001	2012-7-2	102.04	300,000	30,612,000.00
1181382	11扬农CP02	2012-7-2	101.58	300,000	30,474,000.00
041161007	11中电投CP005	2012-7-2	101.56	300,000	30,468,000.00
1181370	11武商贸CP01	2012-7-2	101.46	300,000	30,438,000.00
1181361	11苏国泰CP02	2012-7-2	101.45	300,000	30,435,000.00
1181365	11京客隆CP01	2012-7-2	101.46	300,000	30,438,000.00
1181350	11镇江电CP01	2012-7-2	101.44	300,000	30,432,000.00
1181346	11武水务CP01	2012-7-2	101.44	300,000	30,432,000.00
1181349	11粤水电CP01	2012-7-2	101.43	300,000	30,429,000.00
1181359	11厦钨CP02	2012-7-2	101.28	300,000	30,384,000.00
041264001	12铜陵精达CP001	2012-7-2	102.14	200,000	20,428,000.00
1181389	11惠天CP02	2012-7-2	101.69	200,000	20,338,000.00
1181367	11申华CP01	2012-7-2	101.48	200,000	20,296,000.00
1181368	11珠啤CP02	2012-7-2	101.44	200,000	20,288,000.00
1181327	11昆钢集CP02	2012-7-2	101.20	200,000	20,240,000.00
1181308	11广药CP01	2012-7-2	101.17	100,000	10,117,000.00
合计				45,600,000	4,596,508,000.00

6.4.4.3.2交易所市场债券正回购无。

§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	12,075,564,848.86	35.07
	其中：债券	12,075,564,848.86	35.07
	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	21,686,605,326.20	62.98
4	其他各项资产	673,679,846.95	1.96
5	合计	34,435,850,022.01	100.00

7.2债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号