博时现金收益证券投资基金

[2010] 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：2011年3月31日

§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。本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。

基金的托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年3月30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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者阅读。

本报告期自2010年1月1日至12月31日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

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	4,861,073,427.43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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	128,826,042.27	251,411,812.28	660,547,717.07
本期利润	128,826,042.27	251,411,812.28	660,547,717.07
本期净值收益率	2.14%	1.68%	4.29%
3.1.2期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末基金资产净值	4,861,073,427.43	15,134,457,407.06	33,580,243,723.76
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	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

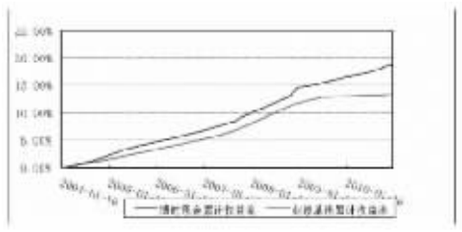
3.2.1基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.8243%	0.0169%	0.0920%	0.0000%	0.7323%	0.0169%
过去六个月	1.4034%	0.0124%	0.1840%	0.0000%	1.2194%	0.0124%
过去一年	2.1389%	0.0090%	0.3650%	0.0000%	1.7739%	0.0090%
过去三年	8.3100%	0.0093%	5.4264%	0.0043%	2.8836%	0.0050%
过去五年	13.7413%	0.0075%	10.0913%	0.0036%	3.6500%	0.0039%
自基金合同生效起至今	19.0824%	0.0065%	13.4481%	0.0031%	5.6343%	0.0034%

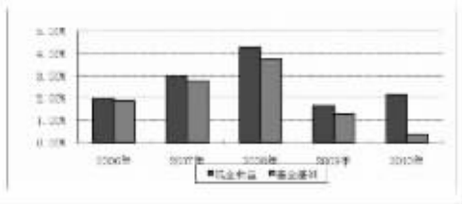
注：本基金成立于2004年1月16日，业绩比较基准是一年期定期存款利率（税后）；

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



3.2.3过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2010年	128,951,454.99	-	-125,412.72	128,826,042.27	-
2009年	266,117,856.01	-	-14,706,043.73	251,411,812.28	-
2008年	645,022,118.45	-	15,525,598.62	660,547,717.07	-
合计	1,040,091,429.45	-	694,142.17	1,040,785,571.62	-

§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2010年12月31日，博时基金公司共管理二十只开放式基金和三只封闭式基金，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、特定资产管理账户，资产管理总规模逾1874亿元，累计分红超过人民币532亿元。博时基金管理有限公司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）客户服务

为提供安全、高效的网上交易环境，博时公司不断升级网上交易系统的安全功能：2010年1月，博时快e通系统增加了动态验证码的功能，对客户身份进行验证；2010年3月，博时快e通直销交易系统在所有密码输入区域都设置了密码安全控件，大大提高了交易安全性。

2010年4月，博时基金客服中心推出了新版的在线客服系统，新系统能够支持更多新功能，例如，客户和坐席均能查到前面等待的客户数量，客户除了在线等待以外，还可以选择留言功能，留下自己的问题和联系方式，客服代表会及时给予回复。同时在线坐席可以根据等待客户的情况，合理控制在线交流节奏。

"博时e视界"于9月18日正式发布，这也是博时基金倾力为投资人打造的与投资专家面对面的全新视听网络平台。

2010年10月，博时基金与中国劳动保障报社联合举办"企业年金管理大家谈"有奖征文活动。向较早建立企业年金计划的企业征集管理经验与其他企业分享。

2010年，博时在全国各地举办各类客户活动、论坛、沙龙等共计1252场，并创新的采用网络会议室，扩大论坛的覆盖面，充分与投资者沟通当前市场的热点问题，受到了广泛大投资者的广泛欢迎。

（2）社会责任

为支援舟曲灾区的救灾善后工作，博时基金公司及全体员工通过博时慈善基金会向甘肃省红十字会捐出赈灾款项人民币30万元。

博时慈善基金会2010年关爱助学现场捐赠仪式于2010年12月6日在中山大学举办，博时以每人5000元的标准向中山大学的21位贫困学生资助善款105000元，至此博时基金第四届百万关爱助学活动圆满落幕。

（3）公司荣誉

博时在由证券时报社主办的2009年度中国明星基金奖评选中，荣获两个奖项，博时主题行业基金获得"2009年度三年持续回报股票型明星基金奖"，博时平衡配置获得"2009年度三年持续回报平衡混合型明星基金奖"。

博时在由中国证券报社主办的第七届中国基金业金牛奖评选中连续第三次荣获中国基金业最具权威的"金牛基金公司奖"，并获得首次设立的"金牛特别贡献奖"，旗下基金博时裕隆封闭、博时主题行业股票、博时平衡配置混合和博时现金收益货币均蝉联金牛奖项，分别获得"三年期封闭式持续优胜金牛基金"、"三年期开放式股票型持续优胜金牛基金"、"三年期开放式混合型持续优胜金牛基金"和"2009年度开放式货币市场金牛基金"奖项。

（4）其他大事件

博时创业成长股票型证券投资基金首募顺利结束并于2010年6月1日成立，首次募集资金超过34亿元。

博时大中华亚太精选股票证券投资基金及博时宏观回报债券型证券投资基金首募顺利结束并于2010年7月27日成立。

博时转债增强债券型证券投资基金及博时行业轮动股票型证券投资基金首次募集顺利结束并分别于2010年11月24日和2010年12月10日成立。

根据中国证券监督管理委员会的批复，博时基金已在香港完成博时基金（国际）有限公司（Bosera Asset Management（International）Co.，Limited）的注册登记手续并获香港证券及期货事务监察委员会颁发的第4类《就证券提供意见》和第9类《提供资产管理》牌照。

博时基金于2010年8月25日和2010年11月11日分别公告郑州分公司和沈阳分公司成立。至此，博时基金已有4家分公司分别落地北京、上海、郑州和沈阳。

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	基金经理	2006-7-01	-	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。现任现金收益基金、博时策略混合基金、博时稳定价值债券基金基金经理。

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》及其各项实施细则、《博时现金收益证券投资基金基金合同》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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于基金规模波动的原因，本基金曾出现债券正回购余额比例超过基金资产净值的20%和定期存款比例被动超过30%的情况，基金管理人择机进行了调整，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本投资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的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

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

（1）行情回顾

2010年全球经济进一步复苏。美联储在第一轮量化宽松之后，继续实行了第二轮的量化宽松政策，美国国内经济出现复苏迹象。欧洲由于部分国家出现债务危机，导致整体复苏节奏迟缓。国内经济快速恢复，但与此同时，通胀也迅速上升，因此，政府在下半年开始将宽松的货币政策转为稳健的货币政策。

回顾10年债券市场，可以分为2个部分。上半年，由于宽松货币政策仍未退出，通胀虽然节节攀升，但没有超过3%这个"心理警戒线"，因此，债券市场有一轮反弹行情。而进入下半年，通胀迅速上升，货币政策也开始转向，准备金率和利率均开始上调，债券市场开始进入下跌周期。

（2）投资思路

在上半年债券市场的反弹行情中，由于短期利率绝对收益较低，本基金基本没有参与。我们进行了大量的定期存款投资以及短融投资，保留大量现金。我们判断2010年通胀水平应该是一路攀升，下半年，央行货币政策开始转向，短期利率开始大幅上升，逐渐进入到可投资区域。我们在下半年加大投资力度，存款，利率产品，信用产品，均开始大幅买入。综合全年，我们投资的时机选择还是比较正确的，全年总体收益回报是比较理想的。

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2.14%，业绩基准增长率为0.37%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2011年，全球经济变化显得扑朔迷离。美国仍会一如既往的实行他们的量化宽松政策，保证经济的复苏。而新兴市场国家的通胀会上升到比较高的水平，导致新兴市场国家的货币政策会转向紧缩。但在大宗商品价格超预期上升的基础上，全球通胀水平也会快速上升，政策的"紧"与"松"相对难以抉择。

国内通胀形式不容乐观，央行的货币政策仍然会坚持紧缩，短期利率在准备金率的多次提升后，会快速上升。2011年的投资，我们仍然坚持谨慎的原则，主要投资于信用产品和定期存款，利率产品择机而动，回购投资也许是2011年比较重要的一个选择。

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128,826,042.27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

2010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

2010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。根据《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》的规定，托管人发现基金存在以下情况："债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%"、"定期存款超过基金资产净值的30%"以及个别监督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，基金管理人进行了调整。本基金本报告期内向份额持有人分配利润：128,826,042.27元。

5.3托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2010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审计报告

博时现金收益证券投资基金2010年年报已经经过普华永道中天会计师事务所审计，会计师出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，应阅读年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1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：2010年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产：		
银行存款	1,351,890,560.92	3,200,777,429.94
结算备付金	9,874,904.63	5,120,233,807.54
存出保证金	-	-
交易性金融资产	3,483,787,915.49	3,682,557,185.32
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,483,787,915.49	3,682,557,185.32
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	210,001,035.00	2,342,844,002.58
应收证券清算款	49,899,985.71	-
应收利息	39,993,217.34	30,584,089.17
应收股利	-	-
应收申购款	660,754.58	765,765,887.53
递延所得税资产	-	-
其他资产	20,000.00	-
资产总计	5,146,128,373.67	15,142,762,402.08
负债和所有者权益	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009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	279,999,660.00	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,445,944.35	3,000,262.82
应付托管费	438,164.93	909,170.55
应付销售服务费	1,095,412.38	2,272,926.38
应付交易费用	33,932.70	40,149.64
应交税费	940,100.00	940,100.00
应付利息	34,758.97	-
应付利润	966,972.91	1,092,385.63
递延所得税负债	-	-
其他负债	100,000.00	50,000.00
负债合计	285,054,946.24	8,304,995.02
所有者权益：		
实收基金	4,861,073,427.43	15,134,457,407.06
未分配利润	-	-
所有者权益合计	4,861,073,427.43	15,134,457,407.06
负债和所有者权益总计	5,146,128,373.67	15,142,762,402.08

注：报告截止日2010年12月31日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额4,861,073,427.43份。

7.2利润表

会计主体：博时现金收益证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入	180,649,046.55	385,490,990.14
1.利息收入	156,952,854.92	326,865,308.41
其中：存款利息收入	44,183,660.09	94,521,508.21
债券利息收入	97,412,745.96	203,103,947.23
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	15,356,448.87	29,239,852.97
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	23,696,191.63	58,185,681.73
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	23,696,191.63	58,185,681.73
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）	-	440,000.00
减：二、费用	51,823,004.28	134,079,177.86
1.管理人报酬	22,231,803.14	55,130,468.41
2.托管费	6,736,909.94	16,706,202.64
3.销售服务费	16,842,275.20	41,765,506.35
4.交易费用	-	-
5.利息支出	5,512,176.03	19,948,441.91
其中：卖出回购金融资产支出	5,512,176.03	19,948,441.91
6.其他费用	499,839.97	528,558.55
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	128,826,042.27	251,411,812.28
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	128,826,042.27	251,411,812.28

7.3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：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31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）	15,134,457,407.06	-	15,134,457,407.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	128,826,042.27	128,826,042.27
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）	-10,273,383,979.63	-	-10,273,383,979.63
其中：1.基金申购款	29,417,904,283.44	-	29,417,904,283.44
2.基金赎回款	-39,691,288,263.07	-	-39,691,288,263.07
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）	-	-128,826,042.27	-128,826,042.27
五、期末所有者权益（基金净值）	4,861,073,427.43	-	4,861,073,427.43
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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）	33,580,243,723.76	-	33,580,243,723.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	251,411,812.28	251,411,812.28
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）	-18,445,786,316.70	-	-18,445,786,316.70
其中：1.基金申购款	83,270,589,067.94	-	83,270,589,067.94
2.基金赎回款	-101,716,375,384.64	-	-101,716,375,384.64
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）	-	-251,411,812.28	-251,411,812.28
五、期末所有者权益（基金净值）	15,134,457,407.06	-	15,134,457,407.06

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：肖风　　主管会计工作负责人：王德英　　会计机构负责人：成江

7.4报表附注

7.4.1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度报告相一致。

7.4.2关联方关系

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、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
中国长城资产管理公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港（集团）有限公司	基金管理人的股东（自2009年11月16日起）
璟安实业有限公司	基金管理人的股东（自2009年11月16日起）
上海盛业资产管理有限公司	基金管理人的股东（自2009年11月16日起）
丰益实业发展有限公司	基金管理人的股东（自2009年11月16日起）

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 股票交易

无。

7.4.3.1.2 权证交易

无。

7.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.3.2关联方报酬

7.4.3.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	22,231,803.14	55,130,468.41
其中：支付销售机构的客户维护费	2,806,080.23	8,674,880.60

支付基金管理人博时基金的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：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数。

7.4.3.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,736,909.94	16,706,202.64

支付基金托管人交通银行的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：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

7.4.3.2.3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 2010年1月1日至2010年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
博时基金	7,484,955.33
交通银行	680,664.61
招商证券	150,116.51
合计	8,315,736.45
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
博时基金	10,037,949.63
交通银行	2,542,831.06
招商证券	373,411.03
合计	12,954,191.72

支付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。

7.4.3.3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 2010年1月1日至2010年12月31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	107,100,061.64	-	-	-	430,000,000.00	21,137.47
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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	-	-	-	-	237,698,500,000.00	10,821,727.10

7.4.3.4各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.3.4.2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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2010年12月31日		上年度末 2009年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券	0.81	0.00%	280,000,000.00	1.85%

7.4.3.5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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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	1,890,560.92	52,298.72	777,429.94	674,574.57
交通银行定期存款	-	6,397,916.76	1,500,000,000.00	539,583.24

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2010年12月31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（2009年12月31日：同）。

7.4.3.6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 2010年1月1日至2010年12月31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
交通银行	1081315	10大重起CP01	簿记建档集中配售	300,000	30,000,000.00
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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
交通银行	0981020	09农垦CP01	簿记建档集中配售	200,000	20,000,000.00
招商证券	0981135	09丰源CP02	簿记建档集中配售	200,000	20,000,000.00
交通银行	0981140	09方正CP02	簿记建档集中配售	700,000	70,000,000.00
交通银行	0981142	09云铜CP01	簿记建档集中配售	1,600,000	159,840,000.00
交通银行	0981166	09沙钢CP01	簿记建档集中配售	1,000,000	99,900,000.00
招商证券	0980147	09中航工债浮	簿记建档集中配售	2,000,000	200,000,000.00

7.4.4期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.4.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.4.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31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279,999,660.00元，是以如下债券作为抵押：

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
100231	10国开31	2011-01-04	99.97	1,000,000	99,974,307.18
100221	10国开21	2011-01-04	99.83	1,000,000	99,825,826.61
010212	01国开12	2011-01-04	101.11	800,000	80,884,785.62
合计	-	-	-	2,800,000	280,684,919.41

7.4.4.3.2交易所市场债券正回购

无余额。

7.4.5有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）公允价值

（2）不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

（3）以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。于2010年12月31日，本基金未持有属于第一层级的以公允价值计量的金融工具（2009年12月31日：同）。

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算）可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。本基金持有属于第二层级的金融工具主要包括银行间市场债券等，于2010年12月31日的余额为3,483,787,915.49元（2009年12月31日：3,682,557,185.32元）。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。于2010年12月31日，本基金未持有属于第三层级的以公允价值计量的金融工具（2009年12月31日：同）。

（4）除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8投资组合报告

8.1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	3,483,787,915.49	67.70
	其中：债券	3,483,787,915.49	67.70
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	210,001,035.00	4.08
	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	1,361,765,465.55	26.46
4	其他各项资产	90,573,957.63	1.76
	合计	5,146,128,373.67	100.00

8.2债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	4.56
	其中：买断式回购融资	-
序号	项目	金额 / 占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	279,999,660.00 / 5.76
	其中：买断式回购融资	- / -

注：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个交易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

金额单位：人民币元

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	2010-06-28	21.15	大额赎回，融资应对。	1个交易日
2	2010-09-28	20.72	巨额赎回	6个交易日

8.3基金投资组合平均剩余期限

8.3.1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	140
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	180
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	57

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

8.3.2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	11.55	5.76
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	12.55	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.23	-
3	60天（含）—90天	29.72	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	10.19	-
4	90天（含）—180天	18.37	-
	其