

博时保证金实时交易型货币市场基金

2015 年度 报告 摘要

7.4.7 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
(a) 金融工具公允价值计量的方法
(a) 公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:
第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。
(b) 持续以公允价值计量的金融工具
(i) 各层次金融工具公允价值
于2015年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为2,977,330,403.42元,无属于第一或第三层次的余额(2014:未持有交易性金融资产)。
(ii) 公允价值所属层次间重大变动
本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具公允价值所属层次未发生重大变动。
(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额
(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具
于2014年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。
(d) 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不多。
(2) 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。

8.1 期末基金份额组合情况

金额单位:人民币元				
序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)	占基金净资产的比例(%)
1	银行存款	2,977,330,403.42	99.97	99.97
2	结算备付金	2,897,300,000.00	-	-
3	存出保证金	-	-	-
4	买入返售金融资产	1,873,194,100.00	64.68	64.68
5	应收利息	2,360,214,000.00	81.24	81.24
6	其他资产	25,145,300.00	0.85	0.85
7	合计	7,779,964,527.39	100.00	100.00

8.2 债券回购明细情况

序号	项目	金额	占基金资产总额的比例(%)
1	报告期内回购明细情况	-	0.00
2	报告期内债券回购余额	-	-
3	报告期内债券回购余额	-	-
4	报告期内债券回购余额	-	-

注:报告期内债券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净资产余额比例的简单平均。

债券正回购余额占基金资产净值的比例为20%的说明
报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。
8.3 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	金额
报告期内投资组合平均剩余期限	181
报告期内投资组合平均剩余期限	181
报告期内投资组合平均剩余期限	181

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
报告期内投资组合平均剩余期限没有超过120天的情况。
8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

1	0-90天	63.88	—
2	90天-180天	13.92	—
3	180天-270天	6.48	—
4	270天-360天	6.48	—
5	360天-450天	6.48	—
6	450天-540天	13.92	—
7	540天-630天	13.92	—
8	630天-720天	13.92	—
9	720天-810天	13.92	—
10	810天-900天	13.92	—
11	900天-1080天	13.92	—
12	1080天-1260天	13.92	—
13	1260天-1440天	13.92	—
14	1440天-1620天	13.92	—
15	1620天-1800天	13.92	—
16	1800天-2160天	13.92	—
17	2160天-2520天	13.92	—
18	2520天-2880天	13.92	—
19	2880天-3240天	13.92	—
20	3240天-3600天	13.92	—
21	3600天-4320天	13.92	—
22	4320天-5040天	13.92	—
23	5040天-5760天	13.92	—
24	5760天-6480天	13.92	—
25	6480天-7200天	13.92	—
26	7200天-7920天	13.92	—
27	7920天-8640天	13.92	—
28	8640天-9360天	13.92	—
29	9360天-10080天	13.92	—
30	10080天-10800天	13.92	—
31	10800天-11520天	13.92	—
32	11520天-12240天	13.92	—
33	12240天-12960天	13.92	—
34	12960天-13680天	13.92	—
35	13680天-14400天	13.92	—
36	14400天-15120天	13.92	—
37	15120天-15840天	13.92	—
38	15840天-16560天	13.92	—
39	16560天-17280天	13.92	—
40	17280天-18000天	13.92	—
41	18000天-18720天	13.92	—
42	18720天-19440天	13.92	—
43	19440天-20160天	13.92	—
44	20160天-20880天	13.92	—
45	20880天-21600天	13.92	—
46	21600天-22320天	13.92	—
47	22320天-23040天	13.92	—
48	23040天-23760天	13.92	—
49	23760天-24480天	13.92	—
50	24480天-25200天	13.92	—
51	25200天-25920天	13.92	—
52	25920天-26640天	13.92	—
53	26640天-27360天	13.92	—
54	27360天-28080天	13.92	—
55	28080天-28800天	13.92	—
56	28800天-29520天	13.92	—
57	29520天-30240天	13.92	—
58	30240天-30960天	13.92	—
59	30960天-31680天	13.92	—
60	31680天-32400天	13.92	—
61	32400天-33120天	13.92	—
62	33120天-33840天	13.92	—
63	33840天-34560天	13.92	—
64	34560天-35280天	13.92	—
65	35280天-36000天	13.92	—
66	36000天-36720天	13.92	—
67	36720天-37440天	13.92	—
68	37440天-38160天	13.92	—
69	38160天-38880天	13.92	—
70	38880天-39600天	13.92	—
71	39600天-40320天	13.92	—
72	40320天-41040天	13.92	—
73	41040天-41760天	13.92	—
74	41760天-42480天	13.92	—
75	42480天-43200天	13.92	—
76	43200天-43920天	13.92	—
77	43920天-44640天	13.92	—
78	44640天-45360天	13.92	—
79	45360天-46080天	13.92	—
80	46080天-46800天	13.92	—
81	46800天-47520天	13.92	—
82	47520天-48240天	13.92	—
83	48240天-48960天	13.92	—
84	48960天-49680天	13.92	—
85	49680天-50400天	13.92	—
86	50400天-51120天	13.92	—
87	51120天-51840天	13.92	—
88	51840天-52560天	13.92	—
89	52560天-53280天	13.92	—
90	53280天-54000天	13.92	—
91	54000天-54720天	13.92	—
92	54720天-55440天	13.92	—
93	55440天-56160天	13.92	—
94	56160天-56880天	13.92	—
95	56880天-57600天	13.92	—
96	57600天-58320天	13.92	—
97	58320天-59040天	13.92	—
98	59040天-59760天	13.92	—
99	59760天-60480天	13.92	—
100	60480天-61200天	13.92	—
101	61200天-61920天	13.92	—
102	61920天-62640天	13.92	—
103	62640天-63360天	13.92	—
104	63360天-64080天	13.92	—
105	64080天-64800天	13.92	—
106	64800天-65520天	13.92	—
107	65520天-66240天	13.92	—
108	66240天-66960天	13.92	—
109	66960天-67680天	13.92	—
110	67680天-68400天	13.92	—
111	68400天-69120天	13.92	—
112	69120天-69840天	13.92	—
113	69840天-70560天	13.92	—
114	70560天-71280天	13.92	—
115	71280天-72000天	13.92	—
116	72000天-72720天	13.92	—
117	72720天-73440天	13.92	—
118	73440天-74160天	13.92	—
119	74160天-74880天	13.92	—
120	74880天-75600天	13.92	—
121	75600天-76320天	13.92	—
122	76320天-77040天	13.92	—
123	77040天-77760天	13.92	—
124	77760天-78480天	13.92	—
125	78480天-79200天	13.92	—
126	79200天-79920天	13.92	—
127	79920天-80640天	13.92	—
128	80640天-81360天	13.92	—
129	81360天-82080天	13.92	—
130	82080天-82800天	13.92	—
131	82800天-83520天	13.92	—
132	83520天-84240天	13.92	—
133	84240天-84960天	13.92	—
134	84960天-85680天	13.92	—
135	85680天-86400天	13.92	—
136	86400天-87120天	13.92	—
137	87120天-87840天	13.92	—
138	87840天-88560天	13.92	—
139	88560天-89280天	13.92	—
140	89280天-90000天	13.92	—
141	90000天-90720天	13.92	—
142	90720天-91440天	13.92	—
143	91440天-92160天	13.92	—
144	92160天-92880天	13.92	—
145	92880天-93600天	13.92	—
146	93600天-94320天	13.92	—
147	94320天-95040天	13.92	—
148	95040天-95760天	13.92	—
149	95760天-96480天	13.92	—
150	96480天-97200天	13.92	—
151	97200天-97920天	13.92	—
152	97920天-98640天	13.92	—
153	98640天-99360天	13.92	—
154	99360天-100080天	13.92	—
155	100080天-100800天	13.92	—
156	100800天-101520天	13.92	—
157	101520天-102240天	13.92	—
158	102240天-102960天	13.92	—
159	102960天-103680天	13.92	—
160	103680天-104400天	13.92	—
161	104400天-105120天	13.92	—
162	105120天-105840天	13.92	—
163	105840天-106560天	13.92	—
164	106560天-107280天	13.92	—
165	107280天-108000天	13.92	—
166	108000天-108720天	13.92	—
167	108720天-109440天	13.92	—
168	109440天-110160天	13.92	—
169	110160天-110880天	13.92	—
170	110880天-111600天	13.92	—
171	111600天-112320天	13.92	—
172	112320天-113040天	13.92	—
173	113040天-113760天	13.92	—
174	113760天-114480天	13.92	—
175	114480天-115200天	13.92	—
176	115200天-115920天	13.92	—
177	115920天-116640天	13.92	—
178	116640天-117360天	13.92	—
179	117360天-118080天	13.92	—
180	118080天-118800天	13.92	—
181	118800天-119520天	13.92	—
182	119520天-120240天	13.92	—
183	120240天-120960天	13.92	—
184	120960天-121680天	13.92	—
185	121680天-122400天	13.92	—
186	122400天-123120天	13.92	—
187	123120天-124080天	13.92	—
188	124080天-125040天	13.92	—
189	125040天-126000天	13.92	—
190	126000天-126960天	13.92	—
191	126960天-127920天	13.92	—
192	127920天-128880天	13.92	—
193	128880天-129840天	13.92	—
194	129840天-130800天	13.92	—
195	130800天-131760天	13.92	—
196	131760天-132720天	13.92	—
197	132720天-133680天	13.92	—
198	133680天-134640天	13.92	—
199	134640天-135600天	13.92	—
200	135600天-136560天	13.92	—
201	136560天-137520天	13.92	—
202	137520天-138480天	13.92	—
203	138480天-139440天	13.92	—
204	139440天-140400天	13.92	—
205	140400天-141360天	13.92	—
206	141360天-142320天	13.92	—
207	142320天-143280天	13.92	—
208	143280天-144240天	13.92	—
209	144240天-145200天	13.92	—
210	145200天-146160天	13.92	—
211	146160天-147120天	13.92	—
212	147120天-148080天	13.92	—
213	148080天-149040天	13.92	—
214	149040天-150000天	13.92	—
215	150000天-150960天	13.92	—
216	150960天-151920天	13.92	—
217	151920天-152880天	13.92	—
218	152880天-153840天	13.92	—
219	153840天-154800天	13.92	—
220	154800天-155760天	13.92	—
221	155760天-156720天	13.92	—
222	156720天-157680天	13.92	—
223	157680天-158640天	13.92	—
224	158640天-159600天	13.92	—
225	159600天-160560天	13.92	—
226	160560天-161520天	13.92	—
227	161520天-162480天	13.92	—
228	162480天-163440天	13.92	—
229	163440天-164400天	13.92	—
230	164400天-165360天	13.92	—
231	165360天-166320天	13.92	—
232	166320天-167280天	13.92	—
233	167280天-168240天	13.92	—
234	168240天-169200天	13.92	—
235	169200天-170160天	13.92	—
236	170160天-171120天	13.92	—
237	171120天-172080天	13.92	—
238	172080天-173040天	13.92	—
239	173040天-174000天	13.92	—
240	174000天-174960天	13.92	—
241	174960天-175920天	13.92	—
242	175920天-176880天	13.92	—
243	176880天-177840天	13.92	—
244	177840天-178800天	13.92	—
245	178800天-179760天	13.92	—
246	179760天-180720天	13.92	—
247	180720天-181680天	13.92	—
248	181680天-182640天	13.92	—
249	182640天-183600天	13.92	—
250	183600天-184560天	13.92	—
251	184560天-185520天	13.92	—
252	185520天-186480天	13.92	—
253	186480天-187440天	13.92	—
254	187440天-188400天	13.92	—
255	188400天-189360天	13.92	—
256	189360天-190320天	13.92	—
257	190320天-191280天	13.92	—
258	191280天-192240天	13.92	—
259	192240天-193200天	13.92	—
260	193200天-194160天	13.92	—
261	194160天-195120天	13.92	—
262	195120天-196080天	13.92	—
263	196080天-197040天	13.92	—
264	197040天-198000天	13.92	—
265	198000天-198960天	13.92	—
266	198960天-199920天	13.92	—
267	199920天-200880天	13.92	—
268	200880天-201840天	13.92	—
269	201840天		