

博时现金宝货币市场基金

2015 第一季度报告

基金管理人：博时基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2015年4月20日

1.1 重要提示
基金管理人及董事承诺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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值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。
基金的投资业绩并不预示其未来表现。投资者在作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告自2015年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	博时现金宝货币
基金代码	060720
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月18日
报告期末基金份额总额	548,896,161.18元
投资目标	在控制投资组合风险、保持相对流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用货币市场管理投资策略，在控制利率风险、尽量降低基金资产净值波动风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中风险最低品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	博时现金宝货币A 博时现金宝货币B
下属两级基金的代码	060720 000091
报告期末下属两级基金的份额总额	529,733,956.41份 19,162,204.77份

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2015年1月1日—2015年3月31日)	博时现金宝货币B
1.本期已实现收益	4,997,585.33	1,238,477.34
2.本期利润	4,997,585.33	1,238,477.34
3.期末基金资产净值	529,733,956.41	19,162,204.77

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。以上数据未经审计，其数据与经审计的年度报告数据可能存在差异。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期间基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2.2.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2.2.2.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2.2.2.2.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

3.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时现金宝货币B

阶段	净值增长率①	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	1.0710%	0.0016%	0.0875%	0.0006%	0.9835%	0.0010%

注：本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。本基金采用摊余成本法计价，计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内，每日计提摊销，计入基金当期损益。本基金申购和赎回价格为1.00元。

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	金额(元)
报告期末投资组合平均剩余期限	112
报告期末投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期末投资组合平均剩余期限最低值	78

注：报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本报告期末货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告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	24.31	10.12
2	30天(含)—60天	--	--
3	60天(含)—90天	41.91	--
4	90天(含)—180天	18.26	--
5	180天(含)—397天	--	--
6	397天以上	23.67	--
合计	108.14	101.12	--

5.4 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	29,969,697.87	5.46
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	220,296,919.12	40.12
6	中期票据	--	--
7	其他	--	--
8	合计	250,176,616.99	45.58

5.5 报告期末按资产类别成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	04184243	14常德CP002	200,000	50,120,442.76	9.13
2	04184143	14鲁信CP001	200,000	30,202,802.82	5.48
3	04184267	14宝安债	200,000	29,994,148.17	5.46