

## 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 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、完整性、及时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的规定，于2015年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等，并不承担基金的盈亏。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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告告期内本基金无发生单一投资人赎回比例达到或者超过基金总份额10%的情况。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

**§ 2 基金产品概况**

基金简称	博时现金宝货币
基金代码	000730
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月18日
报告期末基金份额总额	548,896,116.18份
投资目标	在控制投资风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用积极稳健的投资策略，在控制利率风险、尽量降低基金资产净值波动的风险前提下，提高基金收益。
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，是证券投资基金中的低风险品种，其预期风险和预期收益均低于股票型基金、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

报告期末在货币市场基金中投资组合平均剩余期限不超过120天情况说明

报告期末在货币市场基金中投资组合平均剩余期限不超过120天

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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告告期内未发生单一投资人赎回比例达到或者超过基金总份额10%的情况。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

**§ 3 主要财务指标**

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
其中：剩余期限在97天以上的浮动利差单	-	-	-
2	30天(含)-60天	-	-
其中：剩余期限在97天以上的浮动利差单	-	-	-
3	60天(含)-90天	41.91	-
其中：剩余期限在97天以上的浮动利差单	-	-	-
4	90天(含)-180天	18.26	-
其中：剩余期限在97天以上的浮动利差单	-	-	-
5	180天(含)-397天(含)	23.67	-
其中：剩余期限在97天以上的浮动利差单	-	-	-
合计		108.14	10.12

**§ 4 报告期根据投资品种分类的债券投资组合**

序号	债券品种	摊余成本(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	220,209,912.18	40.12
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	250,176,616.99	45.58
9	剩余期限超过397天的浮动利率债券	-	-

**§ 5 报告期按摊余成本法计算的前十名债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140462042	14银行CP002	500,000	9.13
2	041461043	14浦发银行CP001	300,000	5.48
3	041452057	14信达集团CP001	300,000	5.46
4	15农银03	2016年3月期票	19,984,304.84	3.64
5	041461062	14晋普晋CP002	200,000	3.63
6	041470201	14恒丰银行CP001	200,000	3.63
7	041477001	14光大银行CP001	100,000	1.83
8	041461053	14国开行CP001	100,000	1.83
9	041466010	14京东方CP001	100,000	1.83
10	041562002	15国开行CP001	100,000	1.82

**§ 6.5 报告期未按摊余成本法计算的前十名债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041462042	14银行CP002	500,000	9.13
2	041461043	14浦发银行CP001	300,000	5.48
3	041452057	14信达集团CP001	300,000	5.46
4	15农银03	2016年3月期票	19,984,304.84	3.64
5	041461062	14晋普晋CP002	200,000	3.63
6	041470201	14恒丰银行CP001	200,000	3.63
7	041477001	14光大银行CP001	100,000	1.83
8	041461053	14国开行CP001	100,000	1.83
9	041466010	14京东方CP001	100,000	1.83
10	041562002	15国开行CP001	100,000	1.82

**§ 7.5 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离**

报告期内偏离度绝对值在0.25%以上的次数 0/5 次  
报告期内偏离度的最高值 0.10%  
报告期偏离度的最低值 -0.04%  
报告期偏离度的平均值 0.06%

注:本报告期每10份基金份额产生并分配的收益为人民币0.0016元,扣除相关费用后的余额即为可供分配的基金收益,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构成相同。

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期内基金份额净值增长率及其与同期同业基准收益率比较

3.2.2 报告期内基金净值增长率相对标准差及其与同期同业基准收益率比较

3.2.3 报告期内基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

3.2.4 报告期内基金净值增长率与同期活期存款利率比较

3.2.5 报告期内基金净值增长率与同期一年定期存款利率比较

3.2.6 报告期内基金净值增长率与同期七日年化收益率比较

3.2.7 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.8 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.9 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.10 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.11 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.12 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.13 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.14 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.15 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.16 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.17 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.18 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.19 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.20 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.21 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.22 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.23 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.24 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.25 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.26 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.27 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.28 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.29 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.30 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.31 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.32 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.33 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.34 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.35 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.36 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.37 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.38 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.39 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.40 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.41 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.42 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.43 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.44 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.45 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率比较

3.2.46 报告期内基金净值增长率与同期货币市场基金七日年化收益率