博时现金宝货币市场基金

【2015】第二季度报告

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7月18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7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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时现金宝货币	
基金主代码	000730	
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	710,063,355.12份	
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	本基金将采用积极管理型的投资策略,在控制利率风险、尽量降低基金资产净值波动风险并满足流动性的前提下,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率低于股票型基金、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
下属两级基金的交易代码	000730	000891
报告期末下属两级基金的份额总额	701,672,211.15份	8,391,143.97份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)	
	博时现金宝货币A	博时现金宝货币B
1.本期已实现收益	6,486,437.39	130,246.69
2.本期利润	6,486,437.39	130,246.69
3.期末基金资产净值	701,672,211.15	8,391,143.97

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、博时现金宝货币A:

阶段	净值收益率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	1.1384%	0.0102%	0.0885%	0.0000%	1.0499%	0.0102%

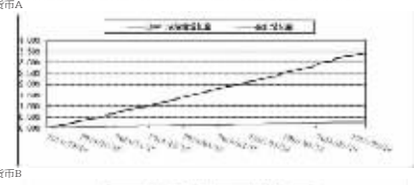
2、博时现金宝货币B:

阶段	净值收益率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	1.1384%	0.0102%	0.0885%	0.0000%	1.0499%	0.0102%

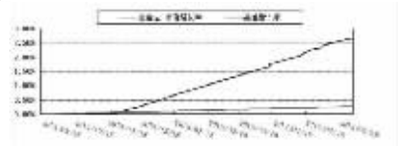
注:自2014年11月21日起对本基金实施基金份额分类,分类后,本基金的A、B基金份额采用统一的收益结转方式。通常情况下本基金的收益结转方式为按日结转,对于日前暂不支持按日结转的销售机构,仍保留按月结转的方式。基金份额分类后,本基金将分设A级和B级两类基金份额,两类基金份额单独设置基金代码,分别公布每万份基金净收益、七日年化收益率,按照相同的费率计提销售服务费用。

3.2.2自基金合同生效以来基金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

1、博时现金宝货币A



2、博时现金宝货币B



注:本基金合同于2014年9月18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6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(三)投资策略的有关约定。本基金建仓期尚未结束。本基金自2014年11月21日起对本基金实施基金份额分类。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张勇	基金经理/固定收益总部现金管理组投资总监	2014-09-18	2015-06-09	11.5	2001年起先后在南京市商业银行任信贷员、债券交易员。2003年加入博时基金管理有限公司,历任债券交易员、基金经理助理、固定收益部副总经理、博时稳定价值债券投资基金、博时现金收益证券投资基金、博时策略灵活配置混合型证券投资基金、博时安盈债券型证券投资基金、博时宏观回报债券型证券投资基金、博时天天增利货币市场基金、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金、博时现金宝货币市场基金、博时保证金实时交易型货币市场基金的基金经理、固定收益总部现金管理组投资总监。
魏桢	基金经理	2014-09-18	-	7	2004年起在厦门市商业银行任债券交易组主管。2008年加入博时基金管理有限公司,历任债券交易员、固定收益研究员。现任博时理财30天债券基金兼博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月薪定期支付债券基金、博时天天增利货币市场基金、博时双月薪定期支付债券基金、博时现金宝货币市场基金、博时现金收益货币基金、博时安盈债券基金、博时保证金货币ETF基金、博时证金宝货币基金的基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、本基金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。

4.3 公平交易专项说明

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报告期内基金投资策略和运作分析

2015年第二季度,受央行大幅降准影响,货币市场流动性十分充裕。银行间R001均值1.55%(-154BP),R007均值4.39%(-190BP)。现券市场先涨后跌,收益率曲线呈现出短端下行幅度大于长端的陡峭化走势,期限利差扩大。高评级信用债收益率下行幅度大于中低评级收益率下行幅度,因此信用利差扩大。1年期短融收益率分别为3.49%(AAA)、3.97%(AA+)、4.39%(AA)。

二季度,本基金秉承理念管理工具的流动性和安全性原则,大类资产配置以存款和短融为主。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为1.14%,B类基金份额净值增长率为1.14%,同期业绩基准增长率0.09%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于IPO频率加快和规模放量可能,资金需求向短端逼近,短期限资金价格将维持低位震荡。预计资金价格仍将保持宽松的状态,且仍有下行空间。广谱利率传导机制不完善,广谱负债利率(理财)对债券收益率下限形成较强约束;传统配置框架的打破需要为配置户的交易化营造环境,长期限的流动性宽松是必要条件,这意味着要么获得被纳基本面的支持,要么要有长期限的政策承诺。经济看平(弱势企稳),周期力量在回升,政策调整在继续,预期的波动性在上升。我们倾向认为于未来货币政策继续宽松的方向依旧明确,未来资金价格仍处在下降的通道之中,供需矛盾方向与经济方向一致,套息和杠杆带来确定性的收益。

本基金将坚持作为流动性管理工具的定位,继续保持投资组合良好的流动性和适度的组合期限。未来一段时间,将继续以票息收入为主,保持债券和存款逆回购的比例。

4.7报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	400,913,668.47	52.03
	其中:债券	400,913,668.47	52.03
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	218,016,847.02	28.29
	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	113,153,825.53	14.68
4	其他资产	38,496,990.25	5.00
5	合计	770,581,331.27	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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		10.30
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	59,944,770.03	8.44
	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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

序号	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	100
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	129
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	100

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
1	2015-4-27	121	为控制流动性风险,到期存款未续做	1
2	2015-5-12	127	为灵活把握流动性安全,买入短融	1
3	2015-5-25	128	为灵活把握流动性安全,买入短融	1
4	2015-6-12	122	为控制流动性风险,到期存款未续做	1
5	2015-6-16	121	为控制流动性风险,到期存款未续做	1
6	2015-6-18	123	为控制流动性风险,到期存款未续做	2
7	2015-6-19	123	为控制流动性风险,到期存款未续做	1
8	2015-6-23	125	为控制流动性风险,到期存款未续做	2
9	2015-6-24	129	为控制流动性风险,到期存款未续做	1

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	48.05	8.44
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	4.23	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	19.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	31.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		103.10	8.44

5.4 报告期末按债券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	39,986,009.26	5.63
	其中:政策性金融债	39,986,009.26	5.63
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	360,927,659.21	50.83
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	400,913,668.47	56.46
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余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	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011586004	15光明SCP004	500,000	50,255,835.83	7.08
2	011598010	15浙物产SCP010	500,000	50,096,630.92	7.06
3	041552007	15农垦CP001	300,000	30,202,616.99	4.25
4	041560017	15森工集CP002	300,000	30,101,692.56	4.24
5	011599281	15雅善江SCP001	300,000	30,002,164.94	4.23
6	041452057	14国安集CP001	300,000	29,996,656.95	4.22
7	041453118	14酒钢CP002	200,000	20,125,996.99	2.83
8	041560014	15森工集CP001	200,000	20,091,984.83	2.83
9	011598008	15浙物产SCP008	200,000	20,078,097.29	2.83
10	071511006	15国信证券CP006	200,000	20,006,076.23	2.82

5.6"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	20次
报告期内偏离度的最高值	0.41%
报告期内偏离度的最低值	0.08%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.21%

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即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,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持1.00元。

5.8.2本基金在报告期内不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮息债的摊余成本超过基金资产净值20%的情况。

5.8.3报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	6,210,347.93
4	应收申购款	32,286,642.32
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	38,496,990.25

5.8.5投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	博时现金宝货币A	博时现金宝货币B
本报告期期初基金份额总额	529,733,956.41	19,162,204.77
本报告期基金总申购份额	2,082,895,454.65	8,527,620.00
本报告期基金总赎回份额	1,910,957,199.91	19,298,680.80
本报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	701,672,211.15	8,391,143.97

注:根据基金管理人2014年11月20日发布的《关于博时现金宝货币市场基金实施份额分类以及调整收益结转方式和修订基金合同及托管协议部分条款的公告》,博时现金宝货币市场基金自2014年11月21日实施基金份额分类以及调整收益结转方式,具体内容请查阅指定报刊上的各项相关公告。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	转出	2015-04-21	-20,000,000.00	-20,000,000.00	0.00%
2	转出	2015-04-22	-40,000,000.00	-40,000,000.00	0.00%
3	转出	2015-04-27	-40,000,000.00	-40,000,000.00	0.00%
4	转入	2015-05-06	40,000,000.00	40,000,000.00	0.00%
5	转入	2015-05-07	40,000,000.00	40,000,000.00	0.00%
6	转出	2015-05-13	-40,000,000.00	-40,000,000.00	0.00%
7	转出	2015-05-18	-40,000,000.00	-40,000,000.00	0.00%
8	转入	2015-05-21	20,000,000.00	20,000,000.00	0.00%
9	申购	2015-05-22	25,000,000.00	25,000,000.00	0.00%
10	转出	2015-06-10	-130,000,000.00	-130,000,000.00	0.00%
11	转入	2015-06-17	80,000,000.00	80,000,000.00	0.00%
合计			-105,000,000.00	-105,000,000.00	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

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2015年6月30日,博时基金公司共管理七十只开放式基金,并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。博时基金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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会批准博时现金宝货币市场基金设立的文件

9.1.2《博时现金宝货币市场基金基金合同》

9.1.3《博时现金宝货币市场基金托管协议》

9.1.4基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.1.5博时现金宝货币市场基金各年度审计报告正本

9.1.6报告期内博时现金宝货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通:95105568(免长途话费)

博时基金管理有限公司
二〇一五年七月十八日

博时现金收益证券投资基金

【2015】第二季度报告

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:2015年7月18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责任。

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2015年7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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时现金收益货币	
基金主代码	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	
报告期末基金份额总额	44,848,678,291.89份	
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	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。	
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	
下属分级基金的基金简称	博时现金收益货币A	博时现金收益货币B
下属分级基金的交易代码	050003	000665
报告期末下属分级基金的份额总额	9,158,055,527.69份	35,690,622,764.20份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)	
	博时现金收益货币A	博时现金收益货币B
1.本期已实现收益	114,757,375.68	351,270,613.86
2.本期利润	114,757,375.68	351,270,613.86
3.期末基金资产净值	9,158,055,527.69	35,690,622,764.20

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、博时现金收益货币A:

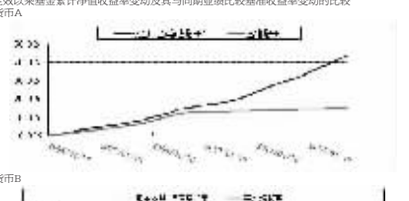
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9497%	0.0026%	0.0885%	0.0000%	0.8612%	0.0026%

2、博时现金收益货币B:

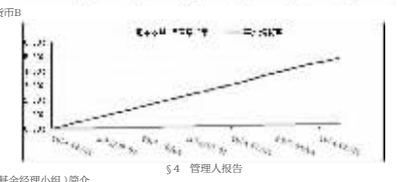
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0105%	0.0026%	0.0885%	0.0000%	0.9220%	0.0026%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

1、博时现金收益货币A



2、博时现金收益货币B



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈凯彬	基金经理/现金管理组投资副总监	2015-05-22	-	10	2003年起先后在深圳发展银行、博时基金、长城基金工作。2009年1月再次加入博时基金管理有限公司。历任固定收益研究员、特定资产投资经理。现任固定收益总部现金管理组投资副总监兼博时安心收益定期开放债券基金、博时理财30天债券基金、博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月薪定期支付债券基金、博时双月薪定期支付债券基金、博时现金收益货币基金、博时证金宝货币基金的基金经理。
魏桢	基金经理	2015-05-22	-	7	2004年起在厦门市商业银行任债券交易组主管。2008年加入博时基金管理有限公司,历任债券交易员、固定收益研究员。现任博时理财30天债券基金兼博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月薪定期支付债券基金、博时安丰18个月定期开放债券(LOF)基金、博时双月薪定期支付债券基金、博时天天增利货币市场基金、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金、博时现金宝货币市场基金、博时现金收益货币基金、博时安盈债券基金、博时保证金货币ETF基金、博时证金宝货币基金的基金经理。
张勇	基金经理/固定收益总部现金管理组投资总监	2006-07-01	2015-05-22	11.5	2001年起先后在南京市商业银行任信贷员、债券交易员。2003年加入博时基金管理有限公司,历任债券交易员、基金经理助理、固定收益部副总经理、博时稳定价值债券投资基金、博时现金收益证券投资基金、博时策略灵活配置混合型证券投资基金、博时安盈债券型证券投资基金、博时宏观回报债券型证券投资基金、博时天天增利货币市场基金、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金、博时现金宝货币市场基金、博时保证金实时交易型货币市场基金的基金经理、固定收益总部现金管理组投资总监。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、本基金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,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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报告期内基金投资策略和运作分析

2015年第二季度,受央行大幅降准影响,货币市场流动性十分充裕。银行间R001均值1.55%(-154BP),R007均值4.39%(-190BP)。现券市场先涨后跌,收益率曲线呈现出短端下行幅度大于长端的陡峭化走势,期限利差扩大。高评级信用债收益率下行幅度大于中低评级收益率下行幅度,因此信用利差扩大。1年期短融收益率分别为3.49%(AAA)、3.97%(AA+)、4.39%(AA)。

二季度,本基金秉承理念管理工具的流动性和安全性原则,大类资产配置以存款和短融为主。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为0.95%,B类基金份额净值增长率为1.01%,业绩基准增长率为0.09%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于IPO频率加快和规模放量可能,资金需求向短端逼近,短期限资金价格将维持低位震荡。预计资金价格仍将保持宽松的状态,且仍有下行空间。广谱利率传导机制不完善,广谱负债利率(理财)对债券收益率下限形成较强约束;传统配置框架的打破需要为配置户的交易化营造环境,长期限的流动性宽松是必要条件,这意味着要么获得被纳基本面的支持,要么要有长期限的政策承诺。经济看平(弱势企稳),周期力量在回升,政策调整在继续,预期的波动性在上升。我们倾向认为于未来货币政策继续宽松的方向依旧明确,未来资金价格仍处在下降的通道之中,供需矛盾方向与经济方向一致,套息和杠杆带来确定性的收益。

本基金将坚持作为流动性管理工具的定位,继续保持投资组合良好的流动性和适度的组合期限。未来一段时间,继续以存款为主要投资工具,标配短期融资券。

4.7报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	固定收益投资	17,847,781,746.31	38.90
	其中:债券	17,847,781,746.31	38.90
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	534,501,201.75	1.16
	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	26,894,755,090.96	58.62
4	其他资产	603,094,839.97	1.31
5	合计	45,880,132,878.99	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	4.55	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	999,999,300.00	2.23
	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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

序号	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	107
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	49

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。

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	46.67	2.23
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.45	-
2	30天(含)—60天	14.43	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	1.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	11.13	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	27.22	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		100.96	2.23

5.4 报告期末按债券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	3,046,664,448.18	6.79
	其中:政策性金融债	3,046,664,448.18	6.79
4	企业债券	252,769,375.80	0.56
5	企业短期融资券	14,548,347,922.33	32.44
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	17,847,781,746.31	39.80
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	202,896,113.72	0.45

5.5 报告期末按摊余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	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150411	15农发11	8,400,000	843,700,296.20	1.88
2	150403	15农发03	5,000,000	500,822,102.73	1.12
3	011522004	15神华SCP004	5,000,000	500,000,070.20	1.11
4	041554027	15铁道CP001	5,000,000	499,711,574.83	1.11
5	140218	14国开18	3,200,000	319,990,124.98	0.71
6	041559019	15永煤控CP001	3,000,000	301,659,839.77	0.67
7	071503006	15中信CP006	3,000,000	299,964,500.66	0.67
8	041556018	15高建投CP001	3,000,000	299,869,939.56	0.67
9	140223	14国开23(增2)	3,000,000	298,866,998.90	0.67
10	150307	15进出07	2,700,000	270,967,831.87	0.60

5.6"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.25%
报告期内偏离度的最低值	0.14%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.19%

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即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,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持1.00元。

5.8.2本基金在报告期内不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮息债的摊余成本超过基金资产净值20%的情况。

5.8.3本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体除15中信CP006(071503006)外,没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

中信证券股份有限公司因存在向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题,被中国证监会采取责令限期改正的行政监管措施。

对该债券投资决策程序的说明:

根据我司的基金投资管理相关制度,以相应的研究报告为基础,结合其未来增长前景,由基金经理决定具体投资行为。

5.8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	404,853,832.02
4	应收申购款	198,145,732.95
5	其他应收款	95,275.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	603,094,839.97

5.8.5投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	博时现金收益货币A	博时现金收益货币B
本报告期期初基金份额总额	13,390,480,298.46	17,247,038,821.30
本报告期基金总申购份额	20,694,396,549.19	62,830,278,239.55
本报告期基金总赎回份额	24,926,821,319.96	44,386,694,296.65
本报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	9,158,055,527.69	35,690,622,764.20

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	转入	2015-04-21	20,000,000.00	20,000,000.00	0.00%
2	转入	2015-04-22	40,000,000.00	40,000,000.00	0.00%
3	转入	2015-04-27	40,000,000.00	40,000,000.00	0.00%
4	申购	2015-04-28	50,000,000.00	50,000,000.00	0.00%
5	转出	2015-05-06	-40,000,000.00	-40,000,000.00	0.00%
6	转出	2015-05-07	-40,000,000.00	-40,000,000.00	0.00%
7	申购	2015-05-13	70,000,000.00	70,000,000.00	0.00%
8	转入	2015-05-13	40,000,000.00	40,000,000.00	0.00%
9	转入	2015-05-18	40,000,000.00	40,000,000.00	0.00%
10	转出	2015-05-21	-5,000,000.00	-5,000,000.00	0.00%
11	赎回	2015-05-26	-229,204,041.29	-229,204,041.29	0.00%
12	转入	2015-06-10	130,000,000.00	130,000,000.00	0.00%
13	转出	2015-06-17	-80,000,000.00	-80,000,000.00