

博时现金宝货币市场基金

[2016] 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:二〇一六年四月二十二日

基金管理人的董事会及基金经理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。

基金托管人中工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、资产净值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。

基金过往业绩并不代表未来表现。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。

本基金中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

序号	平均剩余期限	占份额资产占基金资产净值的比例(%)	各份额货币市场基金资产净值比例(%)
1	0天以内(含)	27.03	12.39
2	1-7天(含)	77.98	—
3	7-14天(含)	—	—
4	14-60天(含)	24.95	—
5	60天以上(含)	71.43	—
6	180天(含)-365天(含)	70.77	—
7	中长期(含以上期限)	—	—
8	合计	308.30	12.39

5.4 报告期末未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	国债	—	—
2	地方政府债	—	—
3	金融债	180,206,823.00	7.24
4	企业债	—	—
5	中期票据	—	—
6	短期融资券	—	—
7	资产支持证券	430,404,212.00	16.97
8	转债	—	—
9	合计	1,080,608,436.00	42.20
10	剩余期限在399天以上的浮息利率债券	—	—
11	合计	1,080,608,436.00	42.20

5.5 报告期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	债券评级	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111010040	08国开0001	AAA	1,000,000.00	0.00
2	111000000	08国债02000	—	3,300,000.00	1.27
3	111010010	08国债0001	—	1,000,000.00	0.37
4	040900002	10海航债0002	—	800,000.00	0.03
5	010900040	10中行债0001	—	700,000.00	0.03
6	10050111	10农行11	—	600,000.00	0.02
7	01090010	10农行02010	—	600,000.00	0.02
8	040900001	10海航债0002	—	600,000.00	0.02
9	040500040	10国开债0001	—	400,000.00	0.01
10	040500040	10国开债0001	—	400,000.00	0.01

5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

注:自2014年11月21日起对本基金货币基金的基金分类,分类后,本基金的A、B类份额采用不同的收益率计算方法,在本基金的下一报告期,本基金的A类份额采用“摊余成本法”计算,即每日资产净值=1.00元,基金收益按每日分配;本基金的B类份额采用“摊余成本法”计算,即每日资产净值=1.00元,基金收益按月度分配。

5.7 报告期末未按资产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

注:自2014年11月21日起对本基金货币基金的基金分类,分类后,本基金的A、B类份额采用不同的收益率计算方法,在本基金的下一报告期,本基金的A类份额采用“摊余成本法”计算,即每日资产净值=1.00元,基金收益按每日分配;本基金的B类份额采用“摊余成本法”计算,即每日资产净值=1.00元,基金收益按月度分配。

5.8 报告期内未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮息债的摊余成本金额为零。

5.9 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的浮息债的摊余成本金额为零。

5.10 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的定期存款的摊余成本金额为零。

5.11 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的存单的摊余成本金额为零。

5.12 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的债券的摊余成本金额为零。

5.13 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的资产支持证券的摊余成本金额为零。

5.14 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的资产支持票据的摊余成本金额为零。

5.15 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的资产支持计划的摊余成本金额为零。

5.16 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的资产支持资产的摊余成本金额为零。

5.17 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融工具的摊余成本金额为零。

5.18 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他资产的摊余成本金额为零。

5.19 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他投资的摊余成本金额为零。

5.20 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融资产的摊余成本金额为零。

5.21 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融负债的摊余成本金额为零。

5.22 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他负债的摊余成本金额为零。

5.23 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融工具的摊余成本金额为零。

5.24 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他资产的摊余成本金额为零。

5.25 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他投资的摊余成本金额为零。

5.26 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融资产的摊余成本金额为零。

5.27 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融负债的摊余成本金额为零。

5.28 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他负债的摊余成本金额为零。

5.29 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融工具的摊余成本金额为零。

5.30 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他资产的摊余成本金额为零。

5.31 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他投资的摊余成本金额为零。

5.32 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融资产的摊余成本金额为零。

5.33 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融负债的摊余成本金额为零。

5.34 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他负债的摊余成本金额为零。

5.35 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融工具的摊余成本金额为零。

5.36 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他资产的摊余成本金额为零。

5.37 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他投资的摊余成本金额为零。

5.38 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融资产的摊余成本金额为零。

5.39 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融负债的摊余成本金额为零。

5.40 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他负债的摊余成本金额为零。

5.41 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融工具的摊余成本金额为零。

5.42 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他资产的摊余成本金额为零。

5.43 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他投资的摊余成本金额为零。

5.44 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融资产的摊余成本金额为零。

5.45 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融负债的摊余成本金额为零。

5.46 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他负债的摊余成本金额为零。

5.47 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融工具的摊余成本金额为零。

5.48 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他资产的摊余成本金额为零。

5.49 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他投资的摊余成本金额为零。

5.50 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融资产的摊余成本金额为零。

5.51 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融负债的摊余成本金额为零。

5.52 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他负债的摊余成本金额为零。

5.53 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融工具的摊余成本金额为零。

5.54 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他资产的摊余成本金额为零。

5.55 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他投资的摊余成本金额为零。

5.56 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融资产的摊余成本金额为零。

5.57 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融负债的摊余成本金额为零。

5.58 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他负债的摊余成本金额为零。

5.59 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融工具的摊余成本金额为零。

5.60 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他资产的摊余成本金额为零。

5.61 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他投资的摊余成本金额为零。

5.62 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融资产的摊余成本金额为零。

5.63 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融负债的摊余成本金额为零。

5.64 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他负债的摊余成本金额为零。

5.65 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他金融工具的摊余成本金额为零。

5.66 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他资产的摊余成本金额为零。

5.67 报告期内未持有剩余期限大于397天但剩余存续期不超过397天的其他投资的摊余