

**2017** 第一季度报告

## 017 第一季度

基金代码	000730	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
基金运作方式	契约开放式	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	20.98	-
基金合同生效日	2014年04月18日	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
报告期末基金总额总额	2,830,676,507.27份	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	20.47	-
投资策略	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。	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	1.00
投资目标	本基金将采用长期稳健的投资策略，在控制风险的前提下，追求基金资产增值及收益并满足流动性的前提下，提高基金收益。	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
业绩比较基准	中证财富债券指数	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

[illegible]

3. 期末基金资产净值	1,698,622,945.33	360,289,690.74	774,762,871.20	其中：政策性金融债	150,247,786.63	5.30
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未实现收益。				4. 企业债券	—	—
				5. 企业短期融资券	—	—

注：本基金采用“买入并持有”策略，投资于股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，投资于可转债资产占基金资产的比例为 0%-40%，投资于现金资产占基金资产的比例为 5%-10%。							6	中国国债		
							7	现金存款	676,047,006.26	23.88
							8	其他		
							9	合计	820,234,793.18	29.36
							10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债		
2. 银行定期存款情况							注：本报告期内未发生基金 A 类基金资产净值较大波动的前十名债券投资情况			
阶段	净值收益率	净值收益率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④				
过去六个月	0.7754%	0.0000%	0.0076%	0.0000%	0.0023%	0.0006%				

过去三个月	0.7697%	0.0006%	0.0875%	0.0000%	0.6822%	0.0006%
3. 理财产品投资:						

[illegible]

8	111693171	16重庆农村商业银行CDO47	500,000	49,040,012.66	1.76
9	111695882	16福建海峡银行CDO29	500,000	49,483,389.83	1.76

2. 跨时区金宝宝货币:		<table> <tr> <th>项目</th><th>报告期末</th></tr> <tr> <td>报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5之间的次数</td><td>0次</td></tr> <tr> <td>报告期内偏离度的最高值</td><td>-0.0633%</td></tr> <tr> <td>报告期内偏离度的最低值</td><td>-0.1595%</td></tr> <tr> <td>报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值</td><td>0.0816%</td></tr> </table>	项目	报告期末	报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5之间的次数	0次	报告期内偏离度的最高值	-0.0633%	报告期内偏离度的最低值	-0.1595%	报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0816%	<table> <tr> <th>项目</th><th>报告期末</th></tr> <tr> <td>报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5之间的次数</td><td>0次</td></tr> <tr> <td>报告期内偏离度的最高值</td><td>-0.0633%</td></tr> <tr> <td>报告期内偏离度的最低值</td><td>-0.1595%</td></tr> <tr> <td>报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值</td><td>0.0816%</td></tr> </table>	项目	报告期末	报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5之间的次数	0次	报告期内偏离度的最高值	-0.0633%	报告期内偏离度的最低值	-0.1595%	报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0816%
项目	报告期末																						
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5之间的次数	0次																						
报告期内偏离度的最高值	-0.0633%																						
报告期内偏离度的最低值	-0.1595%																						
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0816%																						
项目	报告期末																						
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5之间的次数	0次																						
报告期内偏离度的最高值	-0.0633%																						
报告期内偏离度的最低值	-0.1595%																						
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0816%																						

本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未超过0.25%。  
 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明  
 本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未超过0.5%。  
 报告期内基金资产组合投资于国债的比例符合基金合同的约定。

<p>3. 模拟投资组合资产构成:</p>	<p>5.0. 基金资产估值方法</p> <p>5.0.1 基金资产的估值方法</p> <p>本基金采用公允价值进行估值,如估值资料以公允价值为基础确定,则采用公允价值;若无可参考的公允价值且对基金资产净值影响重大的,基金管理公司应当采用适当的方法估值。</p> <p>5.0.2 本基金采用公允价值进行估值,基金资产估值由基金管理人或其委托的基金估值机构负责,估值机构应当遵守法律法规及中国证监会、中国证券业协会的有关规定,估值机构在估值过程中,必须严格按照估值原则,采用适当的估值技术,公允的确定估值结果,估值机构在估值过程中,必须严格按照估值原则,采用适当的估值技术,公允的确定估值结果。</p>
-----------------------	---

序号	名称	金额(元)
1	流动资产	

4.1 基金经理（或基金基金经理小组）简介		5.4 管理人报告	
姓名	职务	任本基金基金经理的期限	证券从业年限
说明			
2004年起在厦门证券业担任证券交易员主管，2008年加入博时基金管理有限公司，历任债券交易员、债券研究员、基金经理助理、基金经理。			
5	任职日期	2015.08.11	15, 081, 617.36
6	任职期间	2015.08.11	41, 464, 250.05
7	其他任职		
8	薪酬情况		
9	其他		

<p>6.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分</p> <p>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。</p>	<p>57,325,898.21</p>
---	----------------------

项目	单位	3月31日			
		博时现金宝货币A	博时现金宝货币B	博时现金宝货币C	博时现金宝货币D
博时现金宝货币A	人民币	1,113,760,000.00	1,722,720,000.00	1,722,720,000.00	1,722,720,000.00
博时现金宝货币B	人民币	11,261,000,000.00	10,160,000,000.00	10,160,000,000.00	10,160,000,000.00
博时现金宝货币C	人民币	10,671,000,000.00	627,039,907.00	3,760,538,114.00	3,760,538,114.00
博时现金宝货币D	人民币	-	-	-	-
博时现金宝货币E	人民币	1,696,622,903.33	300,291,690.00	774,762,871.00	774,762,871.00

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等法律法规及基金合同、托管协议的要求，本着诚实信用、勤勉尽责的原则，规范运作，合规经营，不存在违法违规或违背基金合同和托管协议约定的行为。

本基金管理人于2014年11月20日发布的《关于博时现金宝货币市场基金实施的部分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日实施基金的部分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。

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

[illegible]

公司之一，养老资产管理规模在同行业中名列前茅。

[illegible]

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情况说明

[illegible]

3	银行存款和结算备付金合计	1,053,079,822.36	57.43	2017年1月10日,由信託时报主办的“2016年度金鹏奖金融行业风云榜”颁奖典礼于广州盛大举办,博时基金斩获“年度最佳投研基金公司”大奖。
4	其他资产	57,325,068.21	1.99	2017年1月6日,由东方财富网、天天基金网主办的“2016东方财富风云榜”评选活动于广州举行,博时基金荣膺“2016年度最佳基金公司”大奖,同时,旗下产品博时回报100荣获“2016年度最受欢迎新发基金奖”。

6	合计		2,076,219,107.86	100.00	0.1 基金文件目录
5.2 报告期内基金的投资情况					0.1.1 中国证监会批准设立基金宝货币市场基金设立的文件
1	项目	点基金资产净值比例(%)			0.1.2 中国宝货币市场基金基金合同
1	报告期内发生申购赎回费	6.10			0.1.3 中国宝货币市场基金托管协议
	其中:汇兑费/申购费				0.1.4 基金管理人业务资格批复、营业执照等相关文件
2	项目	金额			0.1.5 中国宝货币市场基金基金定期报告(基金公告)
2	报告期内发生申购赎回费	41,909,727.00	1.60		0.1.6 报告期内中国宝货币市场基金在指定报刊上各商业广告刊载
					0.2 中国宝货币市场基金管理人、基金托管人

	其中：活期存款融资	-	-	9.3 查询方式 投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件 投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司 电话：一、二、三、四、五、六、七、八、九、〇（含长途话费）
--	-----------	---	---	---

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,也不保证最低收益。

基金管理人承诺不从事证券承销业务,不以基金财产从事内幕交易及其他不正当交易。

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,也不保证最低收益。

基金管理人承诺不从事证券承销业务,不以基金财产从事内幕交易及其他不正当交易。

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,也不保证最低收益。

基金管理人承诺不从事证券承销业务,不以基金财产从事内幕交易及其他不正当交易。

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,也不保证最低收益。

基金管理人承诺不从事证券承销业务,不以基金财产从事内幕交易及其他不正当交易。

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,也不保证最低收益。

基金管理人承诺不从事证券承销业务,不以基金财产从事内幕交易及其他不正当交易。

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,也不保证最低收益。

基金管理人承诺不从事证券承销业务,不以基金财产从事内幕交易及其他不正当交易。

3	应收利息	84,476,369.30
4	应收申购款	217,470.21
5	其他应收款	—

一 季 度 报 告		基金资产净值变动情况表	
<p>报告期内净资产的基金余额超过基金净资产值的50%的说明</p> <p>在本报告期内本基金净资产值未超过基金净资产值的50%。</p> <p>5.2 基金权益持有人平均数(基金期间)</p> <p>5.3 权益持有人平均数(基金期间)</p>		<p>5.4 权益持有人报告期内所获的其他文字描述部分</p> <p>由于所有者权益的折旧、贬值之和与合计值之间可能存在误差。</p> <p>5.5 开放式基金份额变动</p>	
项目	天数	权益	基金份额
		单位: 份	

报告期末投资组合平均剩余期限	55	项目	博时双债收益货币A	博时双债收益货币B
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	74	本报告期期初基金份额总额	7,197,080,241.07	66,117,004,741.82
		报告期末基金总申购份额	2,000,508,384.99	28,335,670,264.08

[illegible]

2	30天(含)-60天	31.23	-	3	申购	2017-03-07	80,000,000.00	80,000,000.00	0.00%
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-	4	转出	2017-03-22	-200,000,000.00	-200,000,000.00	0.00%
3	60天(含)-90天	0.48	-						

4	其中:剩余存续期超过207天的浮动利率债务	6,400	--	5	甲寅	2017-03-30	60,000,000.00	60,000,000.00	0.00%		
4	80%(含)~120天	6,777	--	合计			420,000,000.00	420,000,000.00			
	其中:剩余存续期超过207天的浮动利率债务	--	--	d). 报告期限内,一投资者持有基金比例达到或超过20%的情况							
5	120天(含)~207天(含)	23,108	--	e). 报告期限内,一投资者持有基金比例达到或超过20%的情况							
	其中:剩余存续期超过207天的浮动利率债务	--	--	报告期末持有基金情况							
合计		106,205	0.56	投资者	序号	持有基金比例达到或超过20%的日期	期初份额	中期份额	报告期末	持有份额	份额占比
				英属		2017年1月1日, 2017年1月1日					

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明	机	1	月23日至2017年2月7日、 2017年2月17日至2017年2月20日	9,074,787,456.96	60,406,125.06	9,111,446,529.91	23,747,062.11	0.11%
-------------------------------	---	---	--	------------------	---------------	------------------	---------------	-------

[illegible]

5	企业和关联融资	569,900,478.29	2.74
6	中期票据	-	-
7	同业拆借	6,302,964,709.36	29.87

在极值情况下,当持有基金资产占比最高的基金资产持有大量赎回本基金资产时,可能会导致其赎回款占本基金资产规模接近或大于个工作日5000万元,基金还可能面临转换运作方式,与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外,当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额比例达到或者超过50%时,本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额的申购及/或转换转入申请。

[illegible]

	(元)	(%)
1 160211	16周开1(增2)	10,000,000
9	8.8-8.95% CTR	989,977,520.4
9	8.8-8.95% CTR	4.62

[illegible]

9	111696964	16路坊巷支行CDO15	4,000,000	396,917,416.81	1.91
10	111696960	16晋城支行CDO18	4,000,000	396,757,411.82	1.91

序号	事项名称	进展情况
1	基金管理人内部控制制度的完善情况	基金管理人内部控制制度完善情况良好，符合中国证监会《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》的要求。
2	基金管理人内部控制制度的执行情况	基金管理人内部控制制度执行情况良好，符合中国证监会《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》的要求。
3	基金管理人内部控制制度的有效性	基金管理人内部控制制度有效性良好，符合中国证监会《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》的要求。
4	基金管理人内部控制制度的健全性	基金管理人内部控制制度健全性良好，符合中国证监会《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》的要求。
5	基金管理人内部控制制度的独立性	基金管理人内部控制制度独立性良好，符合中国证监会《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》的要求。
6	基金管理人内部控制制度的透明性	基金管理人内部控制制度透明性良好，符合中国证监会《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》的要求。
7	基金管理人内部控制制度的可审计性	基金管理人内部控制制度可审计性良好，符合中国证监会《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》的要求。
8	基金管理人内部控制制度的可执行性	基金管理人内部控制制度可执行性良好，符合中国证监会《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》的要求。
9	基金管理人内部控制制度的可维护性	基金管理人内部控制制度可维护性良好，符合中国证监会《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》的要求。
10	基金管理人内部控制制度的可更新性	基金管理人内部控制制度可更新性良好，符合中国证监会《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》的要求。

<p>本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未达0.25%。</p> <p>报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明</p> <p>本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未达0.5%</p>	<p>9.1 备查文件目录</p> <p>9.1.1 中国证监会批准博时现金收益证券投资基金设立的文件</p> <p>9.1.2《博时现金收益证券投资基金基金合同》</p>
---	--

5.9 将基金份额持有人持有的基金份额折算为整数股并列入前十名大额持有人持股情况说明					0.1.21 将前次收益分配及再投资资金到账日期
序号	证券代码	证券名称	数量(股)	公允价值(元)	0.1.22 基金管理人业务决策程序、授权投资决策流程
					0.1.23 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.24 前次收益分配及再投资资金到账日期
1	542090	100股恒力	800,000.000	34,125,000.000	0.1.25 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.26 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.27 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.28 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.29 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.30 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.31 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.32 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.33 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.34 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.35 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.36 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.37 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.38 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.39 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.40 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.41 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.42 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.43 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.44 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.45 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.46 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.47 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.48 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.49 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.50 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.51 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.52 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.53 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.54 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.55 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.56 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.57 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.58 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.59 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.60 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.61 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.62 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.63 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.64 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.65 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.66 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.67 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.68 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.69 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.70 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.71 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.72 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.73 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.74 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.75 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.76 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.77 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.78 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.79 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.80 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.81 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.82 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.83 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.84 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.85 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.86 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.87 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.88 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.89 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.90 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.91 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.92 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.93 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.94 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.95 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.96 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.97 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.98 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.99 前次收益分配及再投资资金到账日期
					0.1.100 前次收益分配及再投资资金到账日期

6.9.2 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。

#### 5.9.3 其他各项资产构成