

# 博时现金收益证券投资基金

## 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

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：二〇一七年三月二十七日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	
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	
报告期末基金份额总额	73,314,084,982.89 份	
基金合同存续期	不定期	
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	7,197,080,241.07 份	66,117,004,741.82 份

### 2.2 基金产品说明

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	本基金成立于 2004 年 1 月 16 日，业绩比较基准是一年期定期存款利率（税后）； 自 2009 年 7 月 1 日起，本基金的业绩比较基准变更为：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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	博时基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清
	联系电话	0755-83169999
	电子邮箱	service@bosera.com
客户服务电话	95105568	95559
传真	0755-83195140	021-62701216

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

博时现金收益货币 A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	155,821,030.64	378,843,203.35	1,182,705,932.19
本期利润	155,821,030.64	378,843,203.35	1,182,705,932.19
本期净值收益率	2.4958%	3.5234%	4.7308%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末基金资产净值	7,197,080,241.07	7,216,037,659.27	14,518,617,626.70
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

博时现金收益货币 B

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年 6 月 4 日至 2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	2,048,749,235.55	1,402,117,746.84	580,090,821.63
本期利润	2,048,749,235.55	1,402,117,746.84	580,090,821.63
本期净值收益率	2.7421%	3.7727%	2.6526%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末基金资产净值	66,117,004,741.82	66,525,094,753.11	15,048,454,070.13
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

注：1、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。

2、自 2014 年 6 月 3 日起对本基金实施基金份额分类以及调整收益结转方式，调整后，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，对于目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，并按照不同的费率计提销售服务费用。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

博时现金收益货币 A:

阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 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	0.5810%	0.0007%	0.0894%	0.0000%	0.4916%	0.0007%
过去六个月	1.1762%	0.0007%	0.1789%	0.0000%	0.9973%	0.0007%
过去一年	2.4958%	0.0014%	0.3558%	0.0000%	2.1400%	0.0014%
过去三年	11.1268%	0.0038%	1.0656%	0.0000%	10.0612%	0.0038%
过去五年	20.6735%	0.0040%	1.8464%	0.0001%	18.8271%	0.0039%
自基金合同生效 起至今	49.3303%	0.0057%	15.7713%	0.0031%	33.5590%	0.0026%

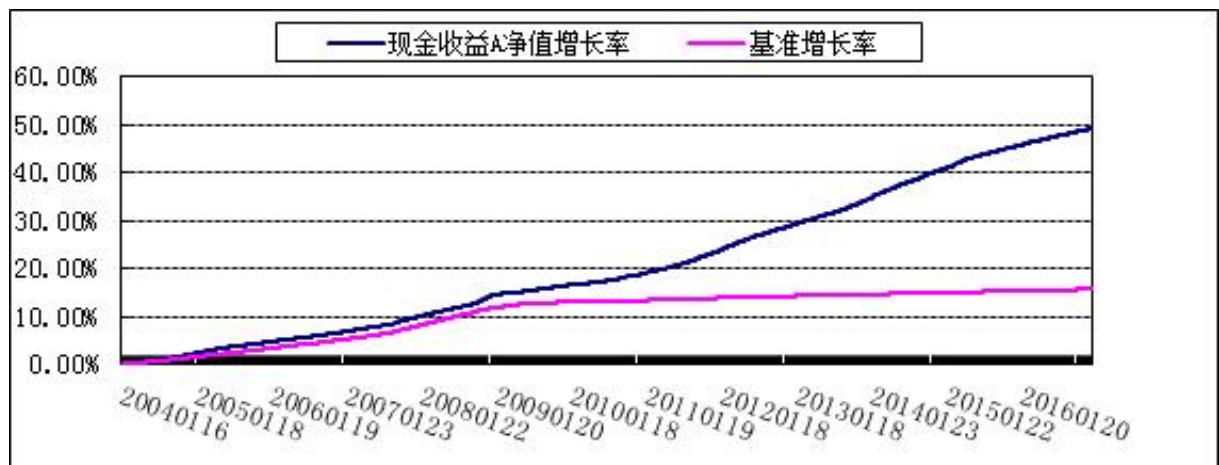
博时现金收益货币 B:

阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 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	0.6415%	0.0007%	0.0894%	0.0000%	0.5521%	0.0007%
过去六个月	1.2983%	0.0007%	0.1789%	0.0000%	1.1194%	0.0007%
过去一年	2.7421%	0.0014%	0.3558%	0.0000%	2.3863%	0.0014%
自基金合同生效 起至今	9.4464%	0.0035%	0.9158%	0.0000%	8.5306%	0.0035%

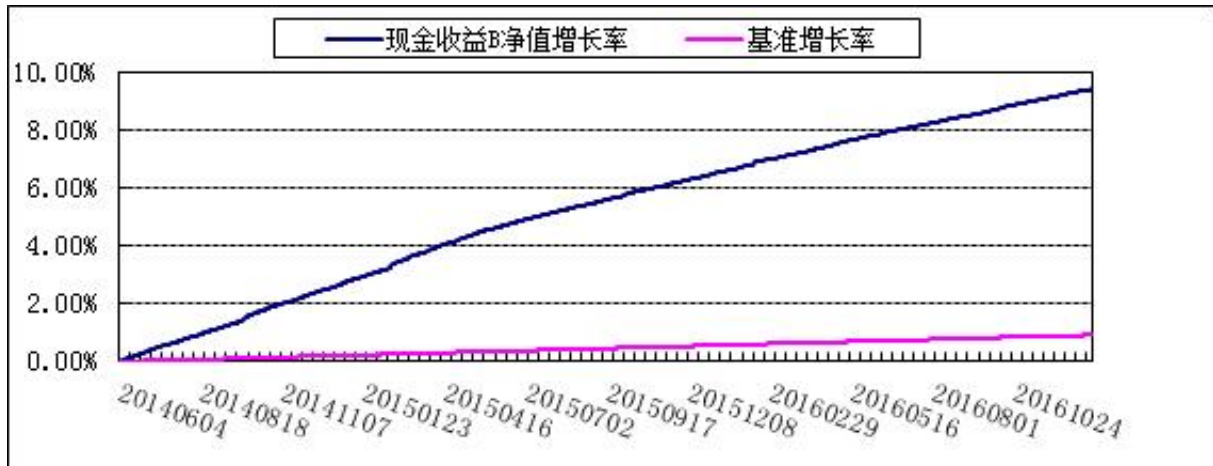
注：本基金成立于 2004 年 1 月 16 日，业绩比较基准是一年期定期存款利率（税后）；  
自 2009 年 7 月 1 日起，本基金的业绩比较基准变更为：活期存款利率（税后）。

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

博时现金收益货币 A

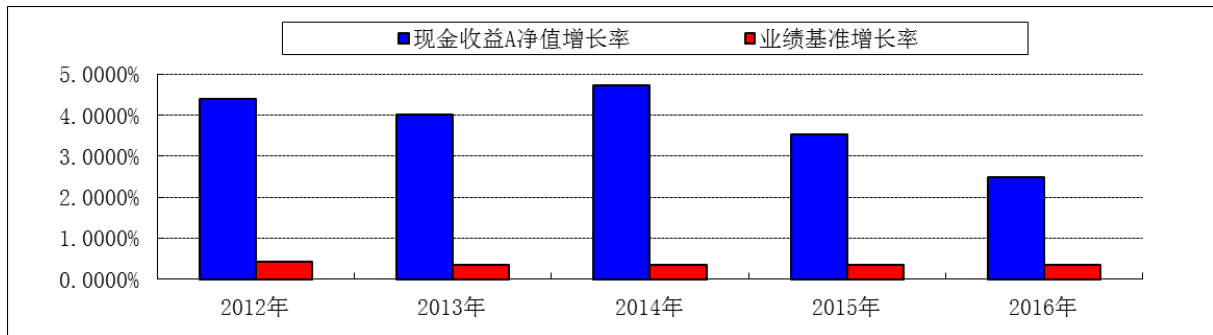


博时现金收益货币 B

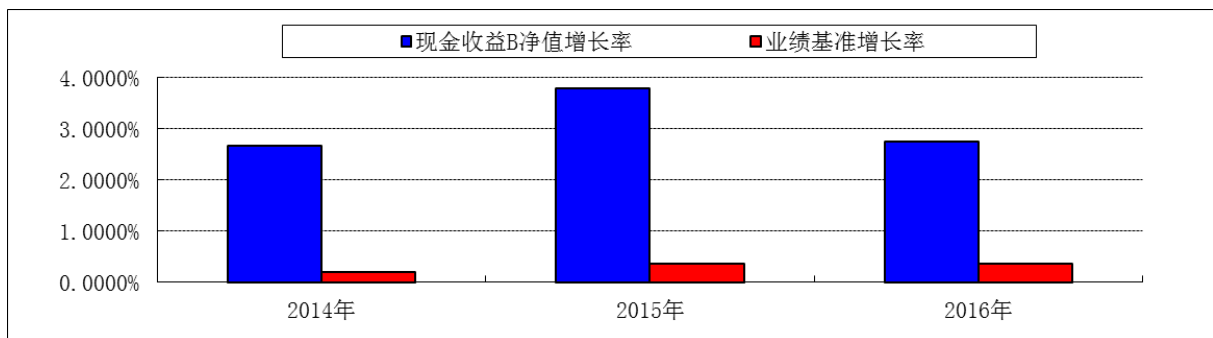


3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时现金收益货币 A



博时现金收益货币 B



3.3 过去三年基金的利润分配情况

博时现金收益货币 A:

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016年	155,736,266.80	-	84,763.84	155,821,030.64	-

2015 年	381,039,972.25	-	-2,196,768.90	378,843,203.35	-
2014 年	1,183,825,565.09	-	-1,119,632.90	1,182,705,932.19	-
合计	1,720,601,804.14	-	-3,231,637.96	1,717,370,166.18	-

博时现金收益货币 B:

单位: 人民币元

年度	已按再投资形式转 实收基金	直接通过应 付赎回款转 出金额	应付利润 本年变动	年度利润分配合计	备注
2016 年	2,047,992,576.73	-	756,658.82	2,048,749,235.55	-
2015 年	1,400,185,551.44	-	1,932,195.40	1,402,117,746.84	-
2014 年	577,224,149.96	-	2,866,671.67	580,090,821.63	-
合计	4,025,402,278.13	-	5,555,525.89	4,030,957,804.02	-

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 2016 年 12 月 31 日,博时基金公司共管理 164 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,管理资产总规模逾 6250 亿元人民币,其中公募基金规模逾 3760 亿元人民币,累计分红逾 781 亿元人民币,是目前我国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。

#### 1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计,截至 2016 年年末,博时旗下共 94 只(份额分开计算)成立满一年的基金产品参与分类排名。其中排名在同类前 1/2 的产品共有 60 只(主动权益 17 只,债券 16 只,指数 20 只,货币 3 只,QDII 基金 4 只),约 64%;排名在前 1/3 的产品共有 45 只,约 48%;排名前 1/4 的产品共有 34 只,约 36%。博时旗下各类产品均有表现突出的产品位居行业前列。

黄金基金类,博时黄金 ETF(D 类)今年以来净值增长率 19.10%,在同类 8 只排名第 1。

固收方面,长期标准债券型基金里,博时双月薪定期支付债券,今年以来净值增长率为 6.54%,在同类 61 只中排名第 2;博时信用债纯债(A 类),今年以来净值增长

率为 4.23%，在同类中排名第 4；中短期标准债券型基金，博时安盈债券（A 类）今年以来净值增长率为 2.02%，在同类 66 只排名第 1；普通债券型基金里，博时稳定价值债券（A 类）今年以来净值增长率为 2.31%，在同类排名前 1/3；货币市场基金里，博时外服货币今年以来净值增长率为 3.03%，同类 194 只排名第 6。

QDII 基金，博时标普 500ETF 今年以来净值增长率 18.34%，同类排名前 1/4。博时亚洲票息收益债券(QDII)今年以来净值增长率 14.43%，同类排名第 3。

## 2、其他大事件

2016 年 12 月 27 日，2016 金融新媒体峰会暨金 V 榜 2016 颁奖典礼在广州举行，博时基金荣获“最具传播力基金公司”奖项。

2016 年 12 月 13 日，由中国经营报主办的“2016 第十四届中国企业竞争力年会暨金融高峰论坛”在北京举行，博时基金荣获“2016 卓越竞争力品牌建设金融机构”奖项。

2016 年 12 月 9 日，在证券日报主办的“第十二届中国证券市场年会”上，博时基金荣膺中国证券市场“2016 年度最全能公募基金龙鼎奖”。

2016 年 12 月 8 日，金融界网站主办的首届智能金融国际论坛暨第五届金融界“领航中国”年度盛典，博时基金荣获“2016 年杰出品牌奖”。

2016 年 12 月 6 日，全国社会保障基金理事会发布公告，博时成为基本养老保险基金首批证券投资机构之一。

2016 年 12 月 1 日，由《经济观察报》主办的“2015-2016 年度观察家金融峰会”在沪举办，博时基金再次独家蝉联“卓越固定收益投资团队奖”。

2016 年 11 月 25 日，由北大汇丰商学院、南方都市报、奥一网联合主办的 2016 年（第二届）CFAC 中国金融年会在深召开，博时基金再次蝉联“年度最佳基金公司大奖”。

2016 年 11 月 23 日，由新浪财经主办的“2016 新浪全球资产管理论坛”在京举行，“2016 中国（首届）波特菲勒奖综合评选”结果揭晓。博时基金荣获“2016 最具互联网创新基金公司”、基金经理过钧获评“2016 最佳债券基金经理”、何凯获“2016 最佳 QDII 基金经理”。本届波特菲勒奖博时基金共斩获三项大奖，成为获奖最多的公募基金之一。

2016 年 11 月 17 日，全国社保基金境内投资管理人 2016 年座谈会在上海举行，博时基金副总裁董良泓荣获“五年服务社保奖”，该奖项授予长期为社保服务且业绩优



秀的投资管理人，本次仅授予 5 人，董良泓先生是自 2015 年之后再次蝉联该奖项。

2016 年 9 月 7 日，第二届结构性融资与资产证券化论坛暨 2016 年度资产证券化·介甫奖颁奖典礼上，“博时资本-平安银行橙鑫橙 e 资产支持专项计划”荣获“应收账款类最受投资者欢迎产品”和“最佳风控产品”两项大奖。

2016 年 8 月 5 日，由 21 世纪经济报道主办的“2016 深港通论坛暨‘金帆奖’系列颁奖礼上，博时一举斩获 2016 年综合实力十强基金公司奖、2016 年互联网突出表现奖、2016 年 ABS 最具实力管理人奖（博时资本）三项大奖。

2016 年 6 月 24 日，由南方日报主办的一年一度“金榕奖”南方金融大奖系列评选正式揭晓，博时基金董事长张光华荣膺“2016 南方金融领导力年度大奖”，博时基金基金经理魏桢荣获“2016 南方金融年度投资理财师”称号。

由中国基金报、香山财富论坛、深圳市政府金融办、国泰基金联合主办的“中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛”2016 年 5 月 13 日在深举行。博时旗下博时信用债券获得“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。

2016 年 5 月 10 日，由上海证券报主办的 2016 中国基金业峰会暨第十三届“金基金”奖颁奖典礼在上海举办，博时基金荣获“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司”大奖。

2016 年 4 月 15 日，由中国基金报主办的第三届中国基金业英华奖评选揭晓，博时基金经理过钧先生获评三年期二级债基最佳基金经理、五年期二级债基最佳基金经理。

2016 年 3 月 27 日，第十三届中国基金业金牛奖揭晓，博时基金摘得了基金业的“奥斯卡”奖——“固定收益投资金牛基金公司”奖。

2016 年 3 月 15 日，由腾讯证券主办的《“挑战 机遇”315 评选——投资者最认同的券商、基金领军人物》评选活动日前揭晓，博时基金董事长张光华先生获评“投资者最认同的公募基金领军人物”，网络票选高居第二位。

2016 年 1 月 18 日，大众证券报“2015 中国基金风云榜”上，博时创业成长（050014）荣获 2015 “最受投资者喜爱基金”奖、博时安丰 18 个月定开债（160515）荣获 2015 “最佳固定收益型基金”奖。

2016 年 1 月 15 日，2016 年金融理财创新与发展论坛暨第六届“金貔貅”奖颁奖在京举办，博时基金获评年度金牌品牌力、金牌创新力两项大奖；博时“存金宝”获年度金牌创新力金融产品奖。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈凯杨	固定收益总部现金管理组投资总监 / 基金经理	2015-05-22	-	11.2	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、博时理财 30 天债券基金基金经理、固定收益总部现金管理组投资副总监、博时外服货币市场基金、博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时裕瑞纯债债券基金、博时裕盈纯债债券基金、博时裕恒纯债债券基金、博时裕荣纯债债券基金、博时裕晟纯债债券基金、博时裕泰纯债债券基金、博时裕丰纯债债券基金、博时裕和纯债债券基金、博时裕坤纯债债券基金、博时裕嘉纯债债券基金、博时裕达纯债债券基金、博时裕康纯债债券基金、博时安心收益定期开放债券基金的基金经理。现任固定收益总部现金管理组投资总监兼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、博时安誉 18 个月定开债基金、博时裕乾纯债债券基金、博时裕腾纯债债券基金、博时安和 18 个月定开债基金、博时安泰 18 个月定开债基金、博时裕安纯债债券基金、博时裕新纯债债券基金、博时安瑞 18 个月定开债基金、博时裕发纯债债券基金、博时安怡 6 个月定开债基金、博时裕景纯债债券基金、博时裕通纯债债券基金、博时安源 18 个月定开债基金、博时裕弘纯债债券基金、博时裕顺纯债债券基金、博时裕昂纯债债券基金、博时裕泉纯债债券基金、博时安祺一年定开债基金、博时裕信纯债债券基金、博时裕诚纯债债券基金、博时安诚 18 个月定开债基金的基金经理。
魏桢	固定收益	2015-05-22	-	8.5	2004 年起在厦门市商业银行任债券

	总部现金管理组投资副总监 / 基金经理				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、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的基金经理。现任固定收益总部现金管理组投资副总监兼博时安丰 18 个月定期开放债券（LOF）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、博时外服货币基金、博时安荣 18 个月定期开放债券基金、博时裕创纯债债券型证券投资基金、博时安润 18 个月定开债基金、博时裕盛纯债债券基金、博时产业债纯债基金、博时安仁一年定开债基金、博时合利货币基金、博时安恒 18 个月定开债基金、博时合鑫货币基金、博时安弘一年定开债基金、博时聚享纯债债券基金、博时裕鹏纯债债券基金的基金经理。
倪玉娟	高级研究员兼基金经理助理	2015-12-21	-	5.4	2011 年至 2014 年在海通证券工作。2014 年 3 月加入博时基金管理有限公司，现任固定收益总部高级研究员兼基金经理助理。

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，

公司进一步完善了《公平交易管理制度》，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2016 年，经济增长在供给侧改革政策贯穿下整体呈现为筑底后逐渐企稳回升的趋势。年初开始经济在总需求不足的拖累下继续下探，工业增加值回落明显。依靠财政发力托底同时搭配中性偏宽松的货币政策，二季度开始工业增加值数据出现企稳，到下半年又转向为小幅回升。供给侧改革政策在工业品库存偏低的背景下对上游工业品价格起到了显著的支撑作用，同时叠加大宗商品价格持续上涨影响，PPI 同比增速持续上行，9 月份由负转正并在 12 月达到 5.5% 的近 5 年新高。CPI 在 3 季度结束了年初以来的持续回落态势，11 月份同比增速回升至 2.3% 的年初高位。

经济增长和通货膨胀企稳回升的基本面趋势下，2016 年资金面走势由上半年的宽松状态转向下半年波动加剧的紧平衡。一季度经济下滑压力明显，人民币持续贬值引发外汇占款流失规模累积较大，央行于 3 月份进行降准将资金面稳定在宽松状态。二季度货币政策延续中性偏宽松基调，资金面保持稳定。进入三季度，央行于 8 月份重启 14 天逆回购，后续“收短放长”的公开市场操作逐渐抬高了资金利率中枢，资金面波动增强。四季度货币政策相对收紧的趋势愈加明显，比如央行考虑将理财纳入 MPA 考核测算框架、多次提及金融“去杠杆”和防范“资产泡沫”、中央经济工作会议要求“调节好货币闸门”等。在叠加人民币贬值速度加快背景下外汇占款流失量继续累积和年底 MPA 考核因素后资金面紧张次数增加，依赖于央行公开市场逆回购和 MLF 净投放才得以缓解。从资金利率走势看，银行间质押式回购 7 天品种加权平均利率从年初的 2.46% 上行 55bp 至年末的 3.01%。

组合操作方面，本基金秉承现金管理工具的流动性、安全性和收益性原则，根据

组合的申购赎回情况结合对货币市场趋势的判断安排足量的流动性应付赎回，同时缩短组合平均剩余期限。在满足安全性和流动性的基础上适当配置短期银行存款，提升了组合回报率。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类基金净值增长率为 2.50%，B 类基金净值增长率为 2.74%，同期业绩基准增长率 0.36%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，经济暂未找到新的增长点，房地产和基建仍将是经济增长最重要的影响因素之一。在基建仅意在托底经济的前提下，今年以来房地产限购政策的严格执行和房地产企业融资限制的加码将对后续房地产销售和投资产生影响，进而较大概率对将来的经济增长形成拖累。通胀方面，食品通胀可能放缓，非食品通胀可能温和上升，通胀整体表现温和的概率较大。节奏可能变现为 1 季度 CPI 整体走高，下半年相对趋稳。从基本面角度来看债券利率还有下行的空间。

2016 年底的中央经济工作会议有意趋向于淡化经济增长目标，强调货币政策稳健中性并首次提到调节好货币闸门。结合央行去年三季度以来多次强调“金融去杠杆”和“防范资产泡沫”、公开市场操作进行“收短放长”以及 2017 年一季度开始理财纳入 MPA 考核测算范围等政策，我们判断货币政策短期内有望进入边际收紧的周期。意味着资金利率中枢继续上行，资金面波动更加频繁将是未来货币市场面临的主要问题。

本基金将坚持作为流动性管理工具的定位，密切跟踪货币市场利率的变动趋势，继续保持良好的流动性和适度的平均剩余期限。未来一段时间，继续以银行存款为主要投资工具，标配短期融资券和存单，在保证组合安全性和流动性的基础上争取获得更佳的投资回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察

稽核报告。

2016 年，我公司根据法律、法规的规定，制定、修订和完善了《博时货币市场基金投资管理制度》、《博时基金国债期货投资管理流程手册》、《博时基金国债期货风险管理流程手册》、《博时基金流动性风险管理制度》、《关联交易管理办法》、《交易部公平交易管理制度》、《博时 ETF 基金风险管理制度》、《博时基金反洗钱工作手册》、《开放式基金业务规则》等制度和流程手册等制度。定期更新了各公募基金的《投资管理细则》，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断完善“博时客户关系管理系统”、“博时投资决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：本基金采用 1.00 元固定份额净值交易方式，自基金成立日起每日将实现的基金净收益分配给基金份额持有人。自 2014 年 6 月 3 日起对本基金实施基金份额分类以及调整收益结转方式，调整后，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，对于目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。

本基金 A 类本报告期内向份额持有人分配利润 155,821,030.64 元，本基金 B 类本报告期内向份额持有人分配利润 2,048,749,235.55 元。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2016 年度，托管人在博时现金收益货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2016 年度，博时基金管理有限公司在博时现金收益货币市场基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内向 A 级份额持有人分配利润：155,821,030.64 元，向 B 级份额持有人分配利润：2,048,749,235.55 元。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2016 年度，由博时基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关博时现金收益货币市场基金的半年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：博时现金收益证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	27,898,913,963.17	38,220,712,205.87
结算备付金	13,573,555.29	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	37,143,945,165.34	34,686,943,753.44
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	37,092,329,165.34	34,686,943,753.44
资产支持证券投资	51,616,000.00	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	7,874,165,291.33	2,647,364,815.29
应收证券清算款	-	-
应收利息	231,078,701.85	596,991,434.04
应收股利	-	-
应收申购款	1,008,931,235.73	1,272,004.92
递延所得税资产	-	-
其他资产	95,275.00	95,275.00
<b>资产总计</b>	<b>74,170,703,187.71</b>	<b>76,153,379,488.56</b>
负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-



卖出回购金融资产款	800,000,000.00	2,359,996,970.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	18,309,419.08	16,768,609.64
应付托管费	25,376,431.22	23,014,796.03
应付销售服务费	1,658,123.43	1,926,094.15
应付交易费用	190,774.11	236,439.64
应交税费	4,080,249.01	4,080,249.01
应付利息	133,333.32	155,465.72
应付利润	6,113,075.15	5,271,652.49
递延所得税负债	-	-
其他负债	756,799.50	796,799.50
<b>负债合计</b>	<b>856,618,204.82</b>	<b>2,412,247,076.18</b>
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	73,314,084,982.89	73,741,132,412.38
未分配利润	-	-
<b>所有者权益合计</b>	<b>73,314,084,982.89</b>	<b>73,741,132,412.38</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>74,170,703,187.71</b>	<b>76,153,379,488.56</b>

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 73,314,084,982.89 份。其中 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 7,197,080,241.07 份；B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 66,117,004,741.82 份。

## 7.2 利润表

会计主体：博时现金收益证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>2,651,161,899.41</b>	<b>2,104,920,678.67</b>
1. 利息收入	2,635,563,282.51	2,066,468,688.69
其中：存款利息收入	1,106,815,045.64	1,220,592,181.50
债券利息收入	1,502,512,721.54	840,619,193.60
资产支持证券利息收入	910,488.74	-
买入返售金融资产收入	25,325,026.59	5,257,313.59
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	15,598,616.90	38,451,989.98
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	15,598,616.90	38,451,989.98
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-

股利收益	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
<b>减：二、费用</b>	<b>446,591,633.22</b>	<b>323,959,728.48</b>
1. 管理人报酬	271,701,955.64	173,169,327.28
2. 托管费	82,333,925.83	52,475,553.74
3. 销售服务费	23,353,098.53	30,532,717.87
4. 交易费用	53,175.00	900.00
5. 利息支出	68,560,807.68	67,174,325.11
其中：卖出回购金融资产支出	68,560,807.68	67,174,325.11
6. 其他费用	588,670.54	606,904.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>2,204,570,266.19</b>	<b>1,780,960,950.19</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>2,204,570,266.19</b>	<b>1,780,960,950.19</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时现金收益证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	73,741,132,412.38	-	73,741,132,412.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,204,570,266.19	2,204,570,266.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-427,047,429.49	-	-427,047,429.49
其中：1. 基金申购款	319,396,923,661.80	-	319,396,923,661.80
2. 基金赎回款	-319,823,971,091.29	-	-319,823,971,091.29
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-2,204,570,266.19	-2,204,570,266.19
五、期末所有者权益（基金净值）	73,314,084,982.89	-	73,314,084,982.89

项目	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	29,567,071,696.83	-	29,567,071,696.83
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	1,780,960,950.19	1,780,960,950.19
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号 填列)	44,174,060,715.55	-	44,174,060,715.55
其中: 1. 基金申购款	282,890,989,206.79	-	282,890,989,206.79
2. 基金赎回款	-238,716,928,491.24	-	-238,716,928,491.24
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的基 金净值变动(净值减少 以“-”号填列)	-	-1,780,960,950.19	-1,780,960,950.19
五、期末所有者权益 (基金净值)	73,741,132,412.38	-	73,741,132,412.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 江向阳 主管会计工作负责人: 王德英 会计机构负责人: 成江

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前, 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不

征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

### 7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司(“博时基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国长城资产管理股份有限公司(“中国长城资管”)	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司(“博时资本”)	基金管理人的子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	271,701,955.64	173,169,327.28
其中：支付销售机构的客户维护费	8,443,488.37	12,371,914.13

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率计提，逐日

累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.33% / 当年天数。

#### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	82,333,925.83	52,475,553.74

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.10% / 当年天数。

#### 7.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时现金收益货币 A	博时现金收益货币 B	合计
博时基金	674,772.02	7,322,886.47	7,997,658.49
交通银行	568,201.95	1,268.71	569,470.66
招商证券	105,952.50	34,291.57	140,244.07
合计	1,348,926.47	7,358,446.75	8,707,373.22
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015年1月1日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时现金收益货币 A	博时现金收益货币 B	合计
博时基金	941,848.84	3,904,400.84	4,846,249.68
交通银行	840,755.94	4,338.29	845,094.23
招商证券	203,175.89	-	203,175.89
合计	1,985,780.67	3,908,739.13	5,894,519.80

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额和 B 基金份额的约定销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日 A/B 类基金资产净值×约定年费率/当年天数

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期					
	2016年1月1日至2016年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出	

交通银行	288,931,307.21	288,928,613.91	-	-	6,554,370,000.00	626,291.74
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易 金额	利息 收入	交易金额	利息支出
交通银行	-	-	-	-	14,470,000,000.00	1,393,434.44

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	博时现金收益货 币A	博时现金收益货币B	博时现金收 益货币A	博时现金收益货币B
期初持有的基金份额	-	221,631,900.09	-	142,940,613.10
期间申购/买入总份额	8,718,747.19	2,218,401,502.25	-	977,895,328.28
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份 额	8,718,747.19	2,412,730,861.31	-	899,204,041.29
期末持有的基金份额	-	27,302,541.03	-	221,631,900.09
期末持有的基金份额占基 金总份额比例	-	0.04%	-	0.33%

注：1. 申购含红利再投、转换入、级别调整入份额，赎回含转换出、级别调整出份额。

2. 基金管理人在本年度本基金的交易委托博时基金直销柜台办理，无申购及赎回费。

##### 7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方 名称	本期末 2016年12月31日			
	博时现金收益货币A		博时现金收益货币B	
	持有的基金 份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
招商证券	-	-	2,000,000,000.00	3.02%
中国长城资管	-	-	638,028,524.13	0.96%
博时资本	-	-	222,832,806.94	0.34%
关联方 名称	上年度末 2015年12月31日			
	博时现金收益货币A		博时现金收益货币B	
	持有的基金 份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例

招商证券	-	-	5,024,982,460.88	7.55%
中国长城资管	-	-	1,001,836,075.46	1.51%
博时资本	-	-	139,277,930.02	0.21%

#### 7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行活期存款	24,913,963.17	513,901.99	20,712,205.87	299,234.61
交通银行定期存款	540,000,000.00	97,398,361.12	-	70,853,805.56

注：1、本基金的活期银行存款和部分定期银行存款由基金托管人交通银行保管，按适用利率或约定利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按约定利率计息。于2016年12月31日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2015年12月31日：同）。

#### 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.5 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额800,000,000.00元，于2017年1月5日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 37,143,945,165.34 元，无属于第一或第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第二层次 34,686,943,753.44 元，无属于第一或第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比
----	----	----	----------



			例 (%)
1	固定收益投资	37,143,945,165.34	50.08
	其中：债券	37,092,329,165.34	50.01
	资产支持证券	51,616,000.00	0.07
2	买入返售金融资产	7,874,165,291.33	10.62
	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	27,912,487,518.46	37.63
4	其他各项资产	1,240,105,212.58	1.67
5	合计	74,170,703,187.71	100.00

## 8.2 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	3.62	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	800,000,000.00	1.09
	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%。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	53
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	137
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	53

### 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	2016-01-22	132	为控制流动性风险，到期现金流应付赎回，到期资产未续作。	10 个交易日
2	2016-01-25	133	为控制流动性风险，到期现金流应付赎回，到期资产未续作。	9 个交易日
3	2016-01-26	137	为控制流动性风险，到期现金流应付赎回，到期资产未续作。	8 个交易日
4	2016-01-27	136	为控制流动性风险，到期现金流应付赎回，到期资产未续作。	7 个交易日
5	2016-01-28	136	为控制流动性风险，到期现金流应付赎回，到期资产未续作。	6 个交易日
6	2016-01-29	136	为控制流动性风险，到期现金流应付赎回，到期资产未续作。	5 个交易日
7	2016-02-01	132	为控制流动性风险，到期现金流应付赎回，到期资产未续作。	4 个交易日
8	2016-02-02	131	为控制流动性风险，到期现金流应付赎回，到期资产未续作。	3 个交易日

9	2016-02-03	126	为控制流动性风险，到期现金流应付赎回，到期资产未续作。	2 个交易日
10	2016-02-04	121	为控制流动性风险，到期现金流应付赎回，到期资产未续作。	1 个交易日

### 8.3.2 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	57.17	1.09
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	12.68	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	9.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	8.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	11.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.48	1.09

### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 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存续期未超过 240 天。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	840,266,961.32	1.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,831,615,547.95	5.23
	其中：政策性金融债	3,831,615,547.95	5.23
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	5,628,621,934.25	7.68
6	中期票据	-	-
7	同业存单	26,791,824,721.82	36.54
8	其他	-	-
9	合计	37,092,329,165.34	50.59
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111610553	16 兴业 CD553	14,000,000	1,398,922,563.03	1.91
2	111610031	16 兴业 CD031	13,000,000	1,298,345,333.79	1.77
3	111610558	16 兴业 CD558	12,100,000	1,208,975,704.73	1.65
4	111610537	16 兴业 CD537	12,000,000	1,192,035,572.60	1.63
5	160209	16 国开 09	11,800,000	1,179,562,408.16	1.61
6	160211	16 国开 11(增 2)	10,000,000	999,924,519.19	1.36
7	111690084	16 南京银行 CD006	10,000,000	998,997,003.84	1.36
8	111690109	16 青岛银行 CD004	10,000,000	998,881,826.75	1.36
9	111690120	16 广东顺德农商行 CD002	10,000,000	998,650,499.83	1.36
10	111695485	16 青岛银行 CD039	10,000,000	998,528,040.39	1.36

### 8.7 “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
报告期内偏离度的最高值	0.2032%
报告期内偏离度的最低值	-0.2374%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0779%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到 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达到 0.5%。

### 8.8 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	142060	16 聚信 A1	800,000.00	51,616,000.00	0.07

### 8.9 投资组合报告附注

#### 8.9.1 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。

8.9.2 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。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	231,078,701.85
4	应收申购款	1,008,931,235.73
5	其他应收款	95,275.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,240,105,212.58

### 8.9.4 其他需说明的重要事项

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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时现金收益货币A	255,115	28,211.12	696,160,024.52	9.67%	6,500,920,216.31	90.33%
博时现金收益货币B	317	208,570,992.88	65,436,927,864.49	98.97%	680,076,877.33	1.03%
合计	255,432	287,019.97	66,133,087,889.01	90.21%	7,180,997,093.64	9.79%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	
		持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时现金收益货币A	4,298,986.59	0.06%
	博时现金收益货币B	-	-
	合计	4,298,986.59	0.01%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万)

		份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时现金收益货币A	>100
	博时现金收益货币B	-
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	博时现金收益货币A	-
	博时现金收益货币B	-
	合计	-

注：本基金的基金经理未持有本基金。

## § 10 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
基金合同生效日(2004年1月16日)基金份额总额	6,285,920,856.25	-
本报告期期初基金份额总额	7,216,037,659.27	66,525,094,753.11
本报告期基金总申购份额	18,466,697,628.58	300,930,226,033.22
减：本报告期基金总赎回份额	18,485,655,046.78	301,338,316,044.51
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,197,080,241.07	66,117,004,741.82

注：根据基金管理人 2014 年 5 月 29 日发布的《博时基金管理有限公司关于博时现金收益证券投资基金实施基金份额分类以及调整收益结转方式的公告》，博时现金收益证券投资基金自 2014 年 6 月 3 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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 140,000 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

无。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国元证券	-	-	26,454,300,000.00	100.00%	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

本基金在本报告期内不存在偏离度绝对值在 0.5%（含）以上的情况。

博时基金管理有限公司  
二〇一七年三月二十七日