博时现金宝货币市场基金
2017 年半年度报告
2017 年 6 月 30 日

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：二〇一七年八月二十四日

§1 重要提示及目录

1.1 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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 1
1.1 重要提示 1
1.2 目录 2
§2 基金简介 4
2.1 基金基本情况 4
2.2 基金产品说明 4
2.3 基金管理人和基金托管人 4
2.4 信息披露方式 4
2.5 其他相关资料 5
§3 主要财务指标和基金净值表现 5
3.1 主要会计数据和财务指标 5
3.2 基金净值表现 5
§4 管理人报告 7
4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
4.8 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 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 15
6.4 报表附注 16
§7 投资组合报告 29
7.1 期末基金资产组合情况 29
7.2 债券回购融资情况 29
7.3 基金投资组合平均剩余期限 30
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 30
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 30
7.6 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 31
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 31
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 31
7.9 投资组合报告附注 32
§8 基金份额持有人信息 32
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 32
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 33
8.3 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 33
§9 开放式基金份额变动 33
§10 重大事件揭示 33
10.1 基金份额持有人大会决议 34
10.2 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 34
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 34

10.4 基金投资策略的改变 34
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 34
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 34
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 34
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 35
10.9 其他重大事件 35
§11 影响投资者决策的其他重要信息 36
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 36
§12 备查文件目录 36
12.1 备查文件目录 36
12.2 存放地点 36
12.3 查阅方式 36

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时现金宝货币市场基金		
基金简称	博时现金宝货币		
基金主代码	000730		
交易代码	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		
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		
报告期末基金份额总额	16,758,179,340.01 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	博时现金宝货币 A	博时现金宝货币 B	博时现金宝货币 C
下属分级基金的交易代码	000730	000891	002855
报告期末下属分级基金的份额总额	6,058,844,383.59 份	384,719,125.12 份	10,314,615,831.30 份

2.2 基金产品说明

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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	郭明
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798
注册地址		广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		张光华	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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
本期已实现收益	36,371,578.92	7,192,553.88	59,399,834.74
本期利润	36,371,578.92	7,192,553.88	59,399,834.74
本期净值收益率	1.7423%	1.7407%	1.7819%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 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
期末基金资产净值	6,058,844,383.59	384,719,125.12	10,314,615,831.30
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 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
累计净值收益率	9.7338%	8.9395%	3.5023%

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 11 月 21 日起对本基金实施基金份额分类以及调整收益结转方式，分类后，现有基金份额类别的基金份额全部自动成为分类后本基金的 A 类份额，新增 B 类基金份额。本基金的 A 类和 B 类基金份额采用不同的收益结转方式，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、博时基金 2016 年 5 月 28 日发布公告，决定自 2016 年 5 月 31 日起对博时现金宝货币市场基金增加 C 类份额。

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

1. 博时现金宝货币 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
过去一个月	0.3467%	0.0005%	0.0292%	0.0000%	0.3175%	0.0005%
过去三个月	0.9644%	0.0009%	0.0885%	0.0000%	0.8759%	0.0009%
过去六个月	1.7423%	0.0013%	0.1760%	0.0000%	1.5663%	0.0013%

过去一年	3.1356%	0.0027%	0.3549%	0.0000%	2.7807%	0.0027%
自基金合同生效起至今	9.7338%	0.0051%	0.9888%	0.0000%	8.7450%	0.0051%

2. 博时现金宝货币 B：

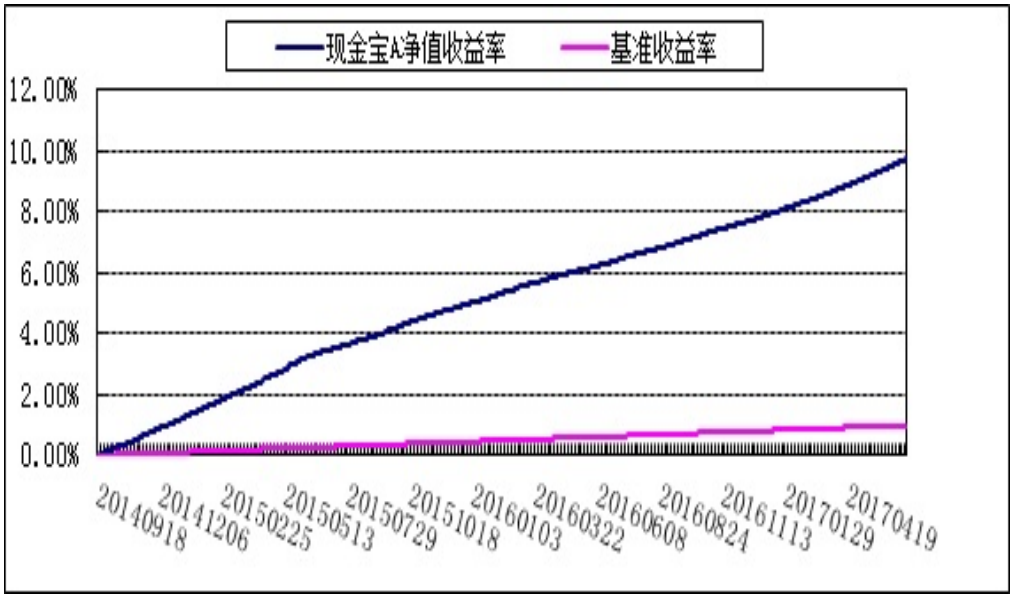
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3463%	0.0005%	0.0292%	0.0000%	0.3171%	0.0005%
过去三个月	0.9636%	0.0009%	0.0885%	0.0000%	0.8751%	0.0009%
过去六个月	1.7407%	0.0013%	0.1760%	0.0000%	1.5647%	0.0013%
过去一年	3.1409%	0.0027%	0.3549%	0.0000%	2.7860%	0.0027%
自基金合同生效起至今	8.9395%	0.0050%	0.9236%	0.0000%	8.0159%	0.0050%

3. 博时现金宝货币 C：

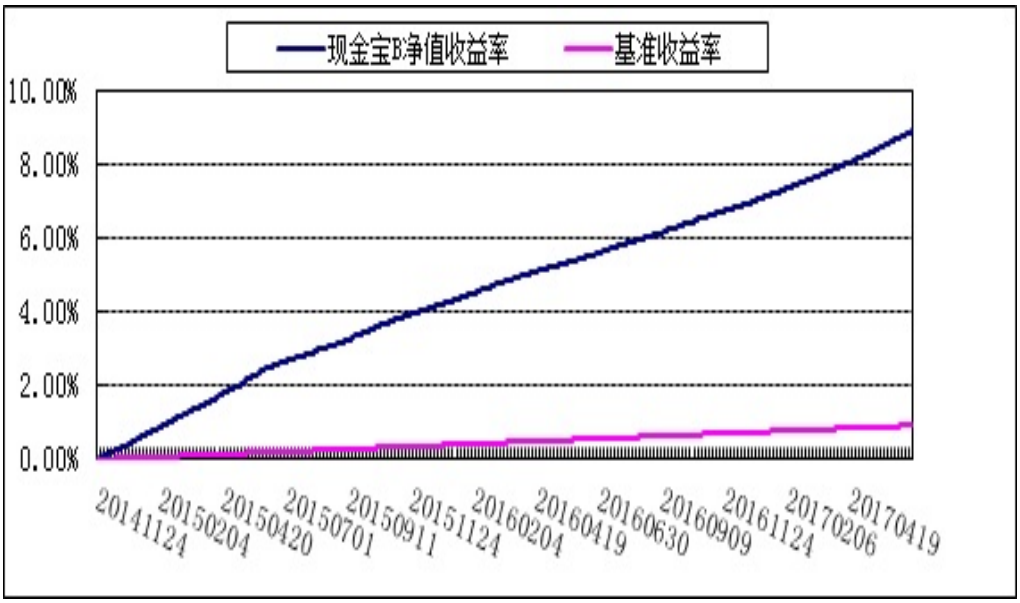
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3627%	0.0005%	0.0292%	0.0000%	0.3335%	0.0005%
过去三个月	1.0044%	0.0011%	0.0885%	0.0000%	0.9159%	0.0011%
过去六个月	1.7819%	0.0015%	0.1760%	0.0000%	1.6059%	0.0015%
过去一年	3.2795%	0.0027%	0.3549%	0.0000%	2.9246%	0.0027%
自基金合同生效起至今	3.5023%	0.0027%	0.3831%	0.0000%	3.1192%	0.0027%

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

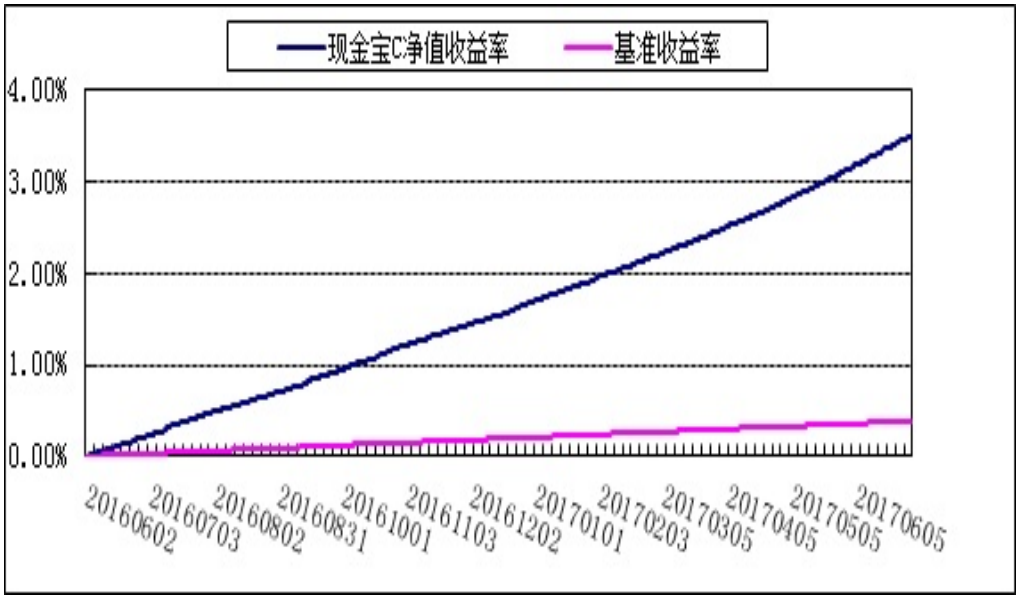
博时现金宝货币 A



博时现金宝货币 B



博时现金宝货币 C



§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 2017 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 186 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 6357.79 亿元人民币，其中公募基金规模逾 3763.55 亿元人民币，累计分红逾 814 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 2017 年 2 季末：

权益基金方面，标准指数股票型基金里，博时深证基本面 200ETF 今年以来净值增长率为 16.07%，在同类 104 只基金中排名前 10，博时裕富沪深 300 指数、博时上证 50ETF 等今年以来净值增长率排名前 1/5；股票型分级子基金里，博时中证银行指数分级 B 今年以来净值增长率为 20.90%，在同类 128 只基金中排名前 1/6；混合偏股型基金中,博时主题行业今年以来净值增长率为 12.13%，在同类基金排名位居前 1/4；混合灵活配置型基金中，博时产业新动力、博时互联网主题基金今年以来净值增长率分别为 8.95%、8.40%，在同类基金中排名均位于前 1/4。

保本型基金中，博时保泰保本混合基金今年以来净值增长率在同类 137 只中排名前 1/3；绝对收益目标基金里，博时新起点灵活配置混合今年以来净值增长率在同类基金中排名前 10。

黄金基金类，博时黄金 ETF(D 类)今年以来净值增长率 3.67%，在同类 14 只中排名第一。

固收方面，长期标准债券型基金中，博时信用债纯债(A 类)、博时裕昂纯债债券基金今年以来净值增长率在同类 797 只排名前 1/10；普通债券型基金中，博时信用债券基金、博时天颐债券基金今年以来净值增长率在 417 只中排名前 1/10；货币市场基金里，博时外服货币今年以来净值增长率在 631 只同类基金中排名前 1/4；转债基金方面，博时转债增强债券(A 类)今年以来收益率 3.78%，同类排名第一。

QDII 基金方面，博时大中华亚太精选股票基金（QDII）、博时大中华亚太精选股票基金（QDII）（美元），今年以来净值增长率分别为 13.46%、15.92%，同类排名前 1/2、1/4。

2、 其他大事件

2017 年 6 月 23 日，由南方日报社主办的“2017 年南方金融峰会暨第六届金榕奖颁奖典礼”在广州举行，博时基金获得“年度资产管理优秀奖”。

2017 年 6 月 17 日，由中国证券报主办的“全球配置时代海外投资动力与机遇——首届海外基金金牛奖颁奖典礼暨高端论坛”在深召开，博时基金海外全资子公司博时基金（国际）有限公司荣获“一年期海外金牛私募管理公司（固定收益策略）”。

2017 年 5 月 12 日，由中国基金报主办的第四届中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛在深召开。博时摘得“2016 年度十大明星基金公司奖”和“2016 年度固定收益投资明星团队奖”两项公司类大奖，博时双月薪和博时稳定价值获“三年持续回报普通债券型明星基金奖”、博时新财富获“2016 年度绝对收益明星基金奖”、博时信用债纯债获“2016 年度积极债券型明星基金奖”、博时信用债券获“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。

2017 年 4 月 25 日，博时基金在 2017 中国基金业峰会暨第十四届中国“金基金”奖颁奖典礼上，获得“2016 年度金基金·TOP 公司奖”。

2017 年 4 月 25 日，在由中国基金报主办的第四届中国基金业英华奖颁奖典礼暨高峰论坛上，博时基金过钧获评“三年期二级债最佳基金经理”、“五年期二级债最佳基金经理”，陈凯杨获评

“三年期纯债型最佳基金经理”。

2017 年 4 月 8 日，在第十四届中国基金业金牛奖颁奖典礼上，博时基金被评为“2016 年度固定收益投资金牛基金公司”，旗下博时卓越品牌混合（160512）被评为“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”、博时主题行业（160505）获“2016 年度开放式混合型金牛基金”、博时信用债券（050011）获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”、博时信用债纯债债券（050027）获“2016 年度开放式债券型金牛基金”。

2017 年 3 月 10 日，由中国工商银行私人银行部举办的“第十八届资本市场投资论坛会议”在杭州落下帷幕。工行私行对管理人的过往表现给予充分肯定并对 2016 年表现突出的管理人进行了表彰，博时基金荣获“2016 年度优秀管理人奖”。

2017 年 2 月 22 日，第二届中国基金业营销创新高峰论坛暨“金果奖”颁奖典礼在京举办，博时基金一举斩获最佳品牌形象建设奖、最具创新精神奖、最佳自媒体建设奖三项大奖。

2017 年 1 月 19 日，深交所召开了新一代交易系统上线运行总结会，会上介绍了深交所新一代交易系统运行情况，并表彰了在新一代交易系统上线过程中，积极参与各项准备和测试工作，为系统顺利上线做出突出贡献的单位和个人。博时基金被授予新一代交易系统建设先行者、突出贡献单位殊荣。博时基金信息技术部车宏原、陈小平、祁晓东被授予突出贡献奖殊荣。

2017 年 1 月 16 日，博时基金荣登中央国债登记结算有限责任公司评选的“优秀资产管理机构”榜单，成为全国十家获此殊荣的基金公司之一。

2017 年 1 月 12 日，由华夏时报、新浪财经联合主办的“第十届金蝉奖颁奖典礼”上，博时基金荣获 “2016 年度市场营销力公司”奖项。

2017 年 1 月 10 日，由信息时报主办的“2016 年度金狮奖金融行业风云榜”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。

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，旗下产品博时银智 100 荣获“2016 年度最受欢迎新发基金奖”。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏桢	固定收益总部现金管理组投资副总监/基金经理	2014-09-18	-	9	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、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、

					博时天天增利货币基金、博时保证金货币 ETF 基金、博时安盈债券基金、博时产业债纯债基金、博时安荣 18 个月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副总监兼博时安丰 18 个月定期开放债券（LOF）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、博时外服货币基金、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、博时合惠货币基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

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 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

2017 年上半年，在经济基本面企稳大背景下，受货币政策中性偏紧和金融监管的影响，债券市场整体呈现熊市格局，债券收益率显著上行。央行在今年 1 季度两次上调政策利率，带动债券收益率向上调整。4、5 月份受经济超预期企稳、货币政策继续收紧、监管从严和委外赎回等因素影响，债券收益率再度大幅上行。5 月末随着货币政策边际放松和金融去杠杆政策协调加强，市场悲观预期缓解，收益率震荡。6 月中旬短期流动性宽松，市场做多热情高涨，带动收益率显著下行。从指数表现看，上半年中债综合财富总值指数-0.12%。

上半年，资金面一直处于紧平衡，货币政策基调稳健中性实则偏紧，央行上调公开市场操作利率，4 月 13 日央行上调 28 天逆回购利率 10bp，4 月 17 日央行上调 MLF 利率 20bp，带动利率走廊上行。上半年期间银行间债券质押式回购 R001 和 R007 加权平均利率平均值分别是 2.77%和 3.35%，较去年一季度平均值 2.33%和 3.09%，分别上行 44bp 和 26bp。央行自 8 月份以来多次强调金融“去杠杆”和“防范资产泡沫”，并辅以公开市场逆回购“收短放长”、考虑将理财纳入 MPA 考核测算框架等措施，我们依然认为资金面整体呈紧平衡状态并且期间波动上升。期限结构比较平坦，短端价格较有优势。

本基金秉承现金管理工具的流动性、安全性和收益性原则，根据对货币市场趋势的判断结合组合流动性特征，主动缩短组合平均剩余期限，安排足量的流动性应付赎回。同时利用逆回购和同业存单收益率走高的机会配置适量仓位，为组合取得了较好的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类基金份额净值收益率为 1.7423%，本基金 B 类基金份额净值收益率为 1.7407%，C 类基金份额净值收益率为 1.7819%，同期业绩基准收益率 0.1760%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为央行控杠杆仍然是一条重要的主线，在央行控杠杆的思路下，资金面整体紧平衡，期限形态仍将维持平坦，短端收益率优势明显。本组合遵循稳定防守的投资理念，以流动性安全为首要目标，并兼顾收益，投资思路上保持中等久期杠杆。

4.6 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。

4.7 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，自基金合同生效日起，本基金 A 类、C 类份额采用“每日分配、按日结转”的方式，即根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行结转；本基金 B 类份额采用“每日分配，按月结转”的方式，即根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每月进行结转。不论何种结转方式，当日收益均参与下一日的收益分配；本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资人不记收益；当进行收益结转时，如投资者的累计未结转收益为正，则为份额持有人增加相应的基金份额；如投资者的累计未结转收益为负，则为份额持有人缩减相应的基金份额；如投资者的累计未结转收益等于零时，份额持有人的基金份额保持不变。

本基金 A 类本报告期内向份额持有人分配利润 36,371,578.92 元，本基金 B 类本报告期内向份额持有人分配利润 7,192,553.88 元，本基金 C 类本报告期内向份额持有人分配利润 59,399,834.74 元。

4.8 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

本报告期内，本基金托管人在对博时现金宝货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，博时现金宝货币市场基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时现金宝货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时现金宝货币市场基金 2016 年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时现金宝货币市场基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	10,465,444,478.13	1,553,332,449.12
结算备付金		1,018,710.56	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	7,687,211,703.55	1,418,556,771.61
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		7,589,131,703.55	1,339,477,371.61
资产支持证券投资		98,080,000.00	79,079,400.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	299,580,849.37	464,781,897.18
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	59,671,827.38	11,714,855.89
应收股利		-	-
应收申购款		58,935,541.55	53,228,167.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		18,571,863,110.54	3,501,614,141.51
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2017 年 6 月 30 日**	**上年度末 2016 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		1,805,566,523.95	177,012,234.48
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,001,627.61	784,992.53
应付托管费		555,856.98	145,369.00
应付销售服务费		1,374,464.69	494,614.74
应付交易费用	6.4.3.7	80,980.06	29,835.35
应交税费		-	-
应付利息		219,855.09	39,030.06
应付利润		1,967,024.86	291,300.58
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	917,437.29	909,000.00
负债合计		1,813,683,770.53	179,706,376.74
所有者权益：		**-**	**-**
实收基金	6.4.3.9	16,758,179,340.01	3,321,907,764.77
未分配利润	6.4.3.10	-	-
所有者权益合计		16,758,179,340.01	3,321,907,764.77
负债和所有者权益总计		18,571,863,110.54	3,501,614,141.51

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额 16,758,179,340.01 份。其中 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 6,058,844,383.59 份；B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 384,719,125.12 份，C 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 10,314,615,831.30 份。

6.2 利润表

会计主体：博时现金宝货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		**122,856,551.37**	**34,722,019.75**
1.利息收入		122,856,304.50	33,244,637.91
其中：存款利息收入	6.4.3.11	81,827,715.84	13,732,789.62
债券利息收入		34,892,004.57	17,946,160.30
资产支持证券利息收入		1,269,905.02	129,525.48
买入返售金融资产收入		4,866,679.07	1,436,162.51
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		246.87	1,477,381.84
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	1,477,381.84
资产支持证券投资收益		246.87	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	-
减：二、费用		**19,892,583.83**	**7,993,858.99**
1．管理人报酬		7,075,807.60	2,797,541.44
2．托管费		1,310,334.77	518,063.29
3．销售服务费		4,254,108.92	2,590,129.39
4．交易费用	6.4.3.17	-	-
5．利息支出		6,997,517.46	1,848,148.77
其中：卖出回购金融资产支出		6,997,517.46	1,848,148.77
6．其他费用	6.4.3.18	254,815.08	239,976.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**102,963,967.54**	**26,728,160.76**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**102,963,967.54**	**26,728,160.76**

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时现金宝货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	3,321,907,764.77	-	3,321,907,764.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	102,963,967.54	102,963,967.54
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）	13,436,271,575.24	-	13,436,271,575.24
其中：1.基金申购款	53,897,047,454.97	-	53,897,047,454.97
2.基金赎回款	-40,460,775,879.73	-	-40,460,775,879.73
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）	-	-102,963,967.54	-102,963,967.54
五、期末所有者权益（基金净值）	16,758,179,340.01	-	16,758,179,340.01
项目	**上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	2,848,164,335.91	-	2,848,164,335.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	26,728,160.76	26,728,160.76
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）	-1,327,550,921.77	-	-1,327,550,921.77

其中：1.基金申购款	8,268,813,315.73	-	8,268,813,315.73
2.基金赎回款	-9,596,364,237.50	-	-9,596,364,237.50
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）	-	-26,728,160.76	-26,728,160.76
五、期末所有者权益（基金净值）	1,520,613,414.14	-	1,520,613,414.14

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 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政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	8,444,478.13

定期存款	10,457,000,000.00
其中：存款期限 1 个月内	300,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	5,780,000,000.00
其中：存款期限 3 个月以上	4,377,000,000.00
其他存款	-
合计	10,465,444,478.13

注：定期存款期限指于资产负债表日定期存单剩余到期期限。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	517,013,271.43	517,218,000.00	204,728.57	0.0012
	银行间市场	7,072,118,432.12	7,079,341,000.00	7,222,567.88	0.0431
	合计	7,589,131,703.55	7,596,559,000.00	7,427,296.45	0.0443

注：偏离金额＝影子定价-摊余成本；
偏离度＝偏离金额/基金资产净值 X100%。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	299,580,849.37	-
合计	299,580,849.37	-

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	7,728.87
应收定期存款利息	51,075,970.86
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	458.40
应收债券利息	7,783,059.72
应收买入返售证券利息	708,718.24
应收申购款利息	-
其他	95,891.29
合计	59,671,827.38

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	80,980.06
合计	80,980.06

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
其他应付款	720,000.00
预提费用	197,437.29
合计	917,437.29

注：其他应付款为管理人维持偏离度而转入本基金的暂付款项。

6.4.3.9 实收基金

博时现金宝货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,118,264,925.19	1,118,264,925.19
本期申购	32,712,716,093.90	32,712,716,093.90
本期赎回（以“-”号填列）	-27,772,136,635.50	-27,772,136,635.50
本期末	6,058,844,383.59	6,058,844,383.59

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

博时现金宝货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	808,271,727.90	808,271,727.90
本期申购	423,254,071.99	423,254,071.99
本期赎回（以“-”号填列）	-846,806,674.77	-846,806,674.77
本期末	384,719,125.12	384,719,125.12

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

博时现金宝货币 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,395,371,111.68	1,395,371,111.68
本期申购	20,761,077,289.08	20,761,077,289.08
本期赎回（以“-”号填列）	-11,841,832,569.46	-11,841,832,569.46

本期末	10,314,615,831.30	10,314,615,831.30

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.3.10 未分配利润

博时现金宝货币 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	36,371,578.92	-	36,371,578.92
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-36,371,578.92	-	-36,371,578.92
本期末	-	-	-

博时现金宝货币 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	7,192,553.88	-	7,192,553.88
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-7,192,553.88	-	-7,192,553.88
本期末	-	-	-

博时现金宝货币 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	59,399,834.74	-	59,399,834.74
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-59,399,834.74	-	-59,399,834.74
本期末	-	-	-

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	30,946.55
定期存款利息收入	81,795,439.89
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,329.40
其他	0.00
合计	81,827,715.84

6.4.3.12 股票投资收益

无发生额。

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,277,661,340.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,270,000,000.00
减：应收利息总额	7,661,340.00
买卖债券差价收入	-

6.4.3.14 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	72,428,507.24
减：卖出资产支持证券成本总额	70,999,400.00
减：应收利息总额	1,428,860.37
资产支持证券投资收益	246.87

6.4.3.15 衍生工具收益

无发生额。

6.4.3.16 股利收益

无发生额。

6.4.3.17 公允价值变动收益

无发生额。

6.4.3.18 交易费用

无发生额。

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
银行汇划费	46,877.79
银行间账户维护费	18,600.00
其他	900.00
合计	254,815.08

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东

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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,075,807.60	2,797,541.44
其中：支付销售机构的客户维护费	768,022.21	1,415,942.34

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 0.27%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 × 0.27% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,310,334.77	518,063.29

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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 × 0.05% / 当年天数。

6.4.6.2.3 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 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	博时现金宝货币 A	博时现金宝货币 B	博时现金宝货币 C	合计
博时基金	1,438,101.04	-	1,271,755.49	2,709,856.53
招商证券	-	-	39,784.68	39,784.68
合计	1,438,101.04	-	1,311,540.17	2,749,641.21

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	博时现金宝货币A	博时现金宝货币B	博时现金宝货币C	合计
博时基金	812,234.17	-	46.73	812,280.90
合计	812,234.17	-	46.73	812,280.90

注：支付基金销售机构的销售服务费 A 类、B 类、C 类按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，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。其计算公式为：

A 类、B 类、C 类日销售服务费＝前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数

博时基金 2017 年 4 月 19 日发布公告，对博时现金宝货币市场基金 C 类份额开展费率优惠活动，2017 年 4 月 19 日至 2017 年 7 月 31 日活动期间，本基金 C 类份额的销售服务费按原费率打折，折后本基金的年销售服务费率为 0.05%。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 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 2017年1月1日至2017年6月30日			上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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A	博时现金宝货币B
基金合同生效日（2014 年 9 月 18 日）持有的基金份额	-	-	-	-	-
期初持有的基金份额	5,296,158.90	-	375.92	4,100,256.58	-
期间申购/买入总份额	200,457,168.89	-	6.53	700,648,839.30	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	200,000,000.00	-	-	600,000,000.00	-
期末持有的基金份额	5,753,327.79	-	382.45	104,749,095.88	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.09%	-	0.00%	6.89%	-

注：1、申购含转换入份额、红利再投份额；赎回含转换出份额。

6.4.6.4.2 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

博时现金宝货币 A

份额单位：份

关联方名称	博时现金宝货币A本期末 2017年6月30日		博时现金宝货币A上年度末 2016年12月31日	
	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	-	-	-	-

博时现金宝货币 C

份额单位：份

关联方名称	博时现金宝货币C本期末 2017年6月30日		博时现金宝货币C上年度末 2016年12月31日	
	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	10.05	0.00%	57,553.47	0.00%

6.4.6.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	8,444,478.13	30,946.55	3,842,538.50	18,751.61

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按约定利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.7 利润分配情况

1、博时现金宝货币 A

单位：人民币元

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	本期利润分配合计	备注
35,778,990.26	-	592,588.66	36,371,578.92	-

注：本基金在本年度累计分配收益 36,371,578.92 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 35,778,990.26 元，计入应付利润科目 592,588.66 元。

2、博时现金宝货币 B

单位：人民币元

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	本期利润分配合计	备注
7,219,610.06	-	-27,056.18	7,192,553.88	-

注：本基金在本年度累计分配收益 7,192,553.88 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 7,219,610.06 元，计入应付利润科目-27,056.18 元。

3、博时现金宝货币 C

单位：人民币元

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	本期利润分配合计	备注
58,289,642.94	-	1,110,191.80	59,399,834.74	-

注：本基金在本年度累计分配收益 59,399,834.74 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 58,289,642.94 元，计入应付利润科目 1,110,191.80 元。

6.4.8 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
146129	花呗27A1	2017-06-22	2017-08-21	新债未上市	100.00	100.00	900,000.00	90,000,000.00	90,000,000.00	-

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,805,566,523.95 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
160308	16 进出 08	2017-07-03	99.94	210,000.00	20,987,400.00
160419	16 农发 19	2017-07-03	100.00	300,000.00	30,000,000.00
170204	17 国开 04	2017-07-03	99.39	1,300,000.00	129,207,000.00
170301	17 进出 01	2017-07-03	99.67	500,000.00	49,835,000.00
170401	17 农发 01	2017-07-03	99.76	800,000.00	79,808,000.00
111697361	16 成都农商银行 CD023	2017-07-07	99.03	1,390,000.00	137,651,700.00
111697446	16 南京银行 CD099	2017-07-03	98.97	1,000,000.00	98,970,000.00
111697703	16 华融湘江银行 CD054	2017-07-03	98.91	1,000,000.00	98,910,000.00
111698940	16 徽商银行 CD100	2017-07-03	99.04	778,000.00	77,053,120.00
111780069	17 锦州银行 CD172	2017-07-07	96.59	3,000,000.00	289,770,000.00
111780093	17 广州农村商业银行 CD122	2017-07-07	95.58	1,220,000.00	116,607,600.00
111794817	17 四川天府银行 CD040	2017-07-07	98.78	420,000.00	41,487,600.00
111796366	17 锦州银行 CD109	2017-07-07	99.75	800,000.00	79,800,000.00
111796462	17 九江银行 CD090	2017-07-03	99.72	900,000.00	89,748,000.00
111796500	17 华融湘江银行 CD036	2017-07-03	99.70	1,200,000.00	119,640,000.00
111799026	17 厦门银行 CD135	2017-07-03	99.10	1,200,000.00	118,920,000.00

111799051	17 江西银行 CD058	2017-07-07	99.10	3,000,000.00	297,300,000.00
合计				19,018,000.00	1,875,695,420.00

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险稳定收益品种。本基金投资的金融工具主要为债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，以实现在保持低风险和高流动性的前提下获得高于投资基准的回报的投资目标。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，定期银行存款存放在具有证券投资基金托管资格的平安银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、上海银行股份有限公司和广发银行股份有限公司，因而与上述银行存款相关的信用风险均不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的

信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券。本基金的基金管理人通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的资产支持证券余额为 98,055,000.00 元， (2016 年 12 月 31 日，本基金持有的资产支持证券余额为 56,000,000.00 元)。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
A-1	39,970,745.87	-
A-1 以下	-	-
未评级	7,459,075,532.36	1,319,201,620.44
合计	7,499,046,278.23	1,319,201,620.44

注：未评级债券为银行间同业存单、政策性金融债以及短期融资券。

6.4.9.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	90,085,425.32	20,275,751.17
合计	90,085,425.32	20,275,751.17

注：未评级债券为银行间同业存单、政策性金融债以及短期融资券。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债和短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，债券正回购的资金余额不得超过基金

资产净值的 20%。

于 2017 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 1,805,566,523.95 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金、买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.9.4.1.1利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月至 1 年	1 至 5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	10,465,444,478.13	-	-	-	10,465,444,478.13
结算备付金	1,018,710.56	-	-	-	1,018,710.56
交易性金融资产	7,597,211,703.55	90,000,000.00	-	-	7,687,211,703.55
买入返售金融资产	299,580,849.37	-	-	-	299,580,849.37
应收利息	-	-	-	59,671,827.38	59,671,827.38
应收申购款	-	-	-	58,935,541.55	58,935,541.55
资产总计	**18,363,255,741.61**	**90,000,000.00**	**-**	**118,607,368.93**	**18,571,863,110.54**
负债					
卖出回购金融资产款	1,805,566,523.95	-	-	-	1,805,566,523.95
应付管理人报酬	-	-	-	3,001,627.61	3,001,627.61
应付托管费	-	-	-	555,856.98	555,856.98
应付销售服务费	-	-	-	1,374,464.69	1,374,464.69
应付交易费用	-	-	-	80,980.06	80,980.06
应付利息	-	-	-	219,855.09	219,855.09
应付利润	-	-	-	1,967,024.86	1,967,024.86
其他负债	-	-	-	917,437.29	917,437.29
负债总计	**1,805,566,523.95**	**-**	**-**	**8,117,246.58**	**1,813,683,770.53**
利率敏感度缺口	**16,557,689,217.66**	**90,000,000.00**	**-**	**110,490,122.35**	**16,758,179,340.01**
上年度末	**6 个月以内**	**6 个月至 1 年**	**1 至 5 年**	**不计息**	**合计**

2016 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	1,553,332,449.12	-	-	-	1,553,332,449.12
结算备付金	-	-	-	-	
交易性金融资产	1,140,439,950.03	278,116,821.58			1,418,556,771.61
买入返售金融资产	464,781,897.18				464,781,897.18
应收利息				11,714,855.89	11,714,855.89
应收申购款				53,228,167.71	53,228,167.71
资产总计	**3,158,554,296.33**	**278,116,821.58**		**64,943,023.60**	**3,501,614,141.51**
负债					
卖出回购金融资产款	177,012,234.48	-	-	-	177,012,234.48
应付管理人报酬	-	-	-	784,992.53	784,992.53
应付托管费	-	-	-	145,369.00	145,369.00
应付销售服务费	-	-	-	494,614.74	494,614.74
应付交易费用	-	-	-	29,835.35	29,835.35
应付利息	-	-	-	39,030.06	39,030.06
应付利润	-	-	-	291,300.58	291,300.58
其他负债	-	-	-	909,000.00	909,000.00
负债总计	**177,012,234.48**	-	-	**2,694,142.26**	**179,706,376.74**
利率敏感度缺口	**2,981,542,061.85**	**278,116,821.58**		**62,248,881.34**	**3,321,907,764.77**

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.9.4.1.2利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	增加约 634.00	增加约 109.00
	市场利率上升 25 个基点	减少约 634.00	减少约 109.00

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.10 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 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 7,687,211,703.55 元，无属于第二层级的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 1,418,556,771.61 元，无属于第二层级的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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。

§7 投资组合报告

7.1 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	7,687,211,703.55	41.39
	其中：债券	7,589,131,703.55	40.86
	资产支持证券	98,080,000.00	0.53
2	买入返售金融资产	299,580,849.37	1.61
	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	10,466,463,188.69	56.36
4	其他各项资产	118,607,368.93	0.64
5	合计	18,571,863,110.54	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	6.62	
	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	1,805,566,523.95	10.77
	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

无。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	97
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	100
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期未出现平均剩余期限超过 120 天的情况。

7.3.2 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	24.97	10.77
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	11.92	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	36.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	5.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	30.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		110.11	10.77

注：本基金本报告期未出现平均剩余存续期超过 240 天的情况。

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期未出现平均剩余存续期超过 240 天的情况。

7.5 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	517,013,271.43	3.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	418,901,018.03	2.50
	其中：政策性金融债	418,901,018.03	2.50
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	149,838,048.83	0.89
6	中期票据	-	-
7	同业存单	6,503,379,365.26	38.81
8	其他	-	-
9	合计	7,589,131,703.55	45.29
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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	111799461	17 九江银行 CD103	5,500,000	537,579,718.17	3.21
2	111799663	17 南京银行 CD120	4,000,000	395,936,831.78	2.36
3	111798988	17 厦门国际银行 CD073	3,000,000	297,397,187.68	1.77
4	111799026	17 厦门银行 CD135	3,000,000	297,287,787.42	1.77
5	111799051	17 江西银行 CD058	3,000,000	297,287,787.42	1.77
6	111715161	17 民生银行 CD161	3,000,000	297,263,952.70	1.77
7	111799835	17 成都农商银行 CD014	3,000,000	296,848,638.22	1.77
8	111799630	17 大连银行 CD110	3,000,000	293,208,313.93	1.75
9	111780069	17 锦州银行 CD172	3,000,000	289,775,607.13	1.73
10	111681045	16 杭州银行 CD192	2,500,000	245,185,780.00	1.46

7.7 “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	0.0501%
报告期内偏离度的最低值	-0.1348%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0518%

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%。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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	146129	花呗 27A1	900,000.00	90,000,000.00	0.54
2	142060	16 聚信 A1	500,000.00	8,080,000.00	0.05

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	59,671,827.38
4	应收申购款	58,935,541.55
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	118,607,368.93

7.9.4 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
博时现金宝货币 A	433,522	13,975.86	32,293,534.12	0.53%	6,026,550,849.47	99.47%
博时现金宝货币 B	178,861	2,150.94	305.58	0.00%	384,718,819.54	100.00%
博时现金宝货币 C	113,638	90,767.31	4,184,543,257.32	40.57%	6,130,072,573.98	59.43%
合计	726,021	23,082.22	4,216,837,097.02	25.16%	12,541,342,242.99	74.84%

8.2 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）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时现金宝货币 A	11,054,073.53	0.18%
	博时现金宝货币 B	700,784.81	0.18%
	博时现金宝货币 C	2,226,073.08	0.02%
	合计	13,980,931.42	0.08%

8.3 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	博时现金宝货币 A	>100
	博时现金宝货币 B	
	博时现金宝货币 C	50~100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	博时现金宝货币 A	-
	博时现金宝货币 B	-
	博时现金宝货币 C	-
	合计	-

§9 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	博时现金宝货币 C
本报告期期初基金份额总额	1,118,264,925.19	808,271,727.90	1,395,371,111.68
本报告期基金总申购份额	32,712,716,093.90	423,254,071.99	20,761,077,289.08
减：本报告期基金总赎回份额	27,772,136,635.50	846,806,674.77	11,841,832,569.46

本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,058,844,383.59	384,719,125.12	10,314,615,831.30

注：博时基金 2016 年 5 月 28 日发布公告，决定自 2016 年 5 月 31 日起对博时现金宝货币市场基金增加 C 类份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 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

1、本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 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（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

中金公司	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48 号）的有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

(1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议

10.7.2 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
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	1,347,900,000.00	100.00%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

10.8 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。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于博时现金宝货币市场基金 A 类份额新增湖北银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-06-28
2	关于博时现金宝货币市场基金 C 类份额新增蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-06-16
3	关于博时现金宝货币市场基金 A 类份额增加和谐保险销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-06-01
4	博时基金管理有限公司关于直销网上交易调整博时现金宝货币市场基金快速赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-05-26
5	博时现金宝货币市场基金 C 类份额开放日常	中国证券报、上海证券	2017-05-20

	转换、定期定额投资业务公告	报、证券时报	
6	关于博时旗下部分开放式基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-05-15
7	博时现金宝货币市场证券投资基金招募说明书 2017 年第 1 号（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-05-02
8	博时现金宝货币市场证券投资基金更新招募说明书 2017 年第 1 号（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-05-02
9	博时现金宝货币市场基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-04-22
10	博时基金管理有限公司关于博时现金宝货币市场基金 C 类份额费率折扣的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-04-19
11	博时现金宝货币市场基金 2016 年年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-03-27
12	博时现金宝货币市场基金 2016 年年度报告（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-03-27
13	博时现金宝货币市场基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-01-21

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会批准博时现金宝货币市场基金设立的文件

12.1.2《博时现金宝货币市场基金基金合同》

12.1.3《博时现金宝货币市场基金托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.1.5 博时现金宝货币市场基金各年度审计报告正本

12.1.6 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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 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

二〇一七年八月二十四日