

**博时现金收益证券投资基金**  
**2018 年半年度报告**  
**2018 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十九日

## § 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 28 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>4</b>
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	5
2.5 其他相关资料	5
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
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合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 债券回购融资情况	33
7.3 基金投资组合平均剩余期限	33
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	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	34
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	34
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	34
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	35
7.9 投资组合报告附注	35
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b>	<b>35</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	35
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	36
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	36
8.4 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	36
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b>	<b>36</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b>	<b>37</b>

10.1 基金份额持有人大会决议.....	37
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.....	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	37
10.4 基金投资策略的改变.....	37
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	37
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.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	37
10.9 其他重大事件.....	37
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>38</b>
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.....	38
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	38
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>39</b>
12.1 备查文件目录.....	39
12.2 存放地点.....	39
12.3 查阅方式.....	39

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时现金收益证券投资基金	
基金简称	博时现金收益货币	
基金主代码	050003	
交易代码	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	152,334,390,648.47 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	146,758,609,844.07 份	5,575,780,804.40 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	陆志俊
	联系电话	0755-83169999	95559
	电子邮箱	service@bosera.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		95105568	95559
传真		0755-83195140	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
邮政编码	518040	200120
法定代表人	张光华	彭纯

## 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	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
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（2018 年 1 月 1 日-2018 年 6 月 30 日）	
	博时现金收益货币 A	博时现金收益货币 B
本期已实现收益	739,418,746.48	239,878,512.85
本期利润	739,418,746.48	239,878,512.85
本期净值收益率	1.9974%	2.1168%
3.1.2 期末 数据和指标	报告期末（2018 年 6 月 30 日）	
	博时现金收益货币 A	博时现金收益货币 B
期末基金资产净值	146,758,609,844.07	5,575,780,804.40
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计 期末指标	报告期末（2018 年 6 月 30 日）	
	博时现金收益货币 A	博时现金收益货币 B
累计净值收益率	57.4351%	15.7996%

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

##### 1. 博时现金收益货币 A:

阶段	份额净值收 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
过去一个月	0.3016%	0.0000%	0.0292%	0.0000%	0.2724%	0.0000%
过去三个月	0.9706%	0.0011%	0.0885%	0.0000%	0.8821%	0.0011%
过去六个月	1.9974%	0.0009%	0.1760%	0.0000%	1.8214%	0.0009%
过去一年	3.8702%	0.0010%	0.3549%	0.0000%	3.5153%	0.0010%
过去三年	9.5880%	0.0021%	1.0656%	0.0000%	8.5224%	0.0021%
自基金合同生效 起至今	57.4351%	0.0055%	16.3021%	0.0030%	41.1330%	0.0025%

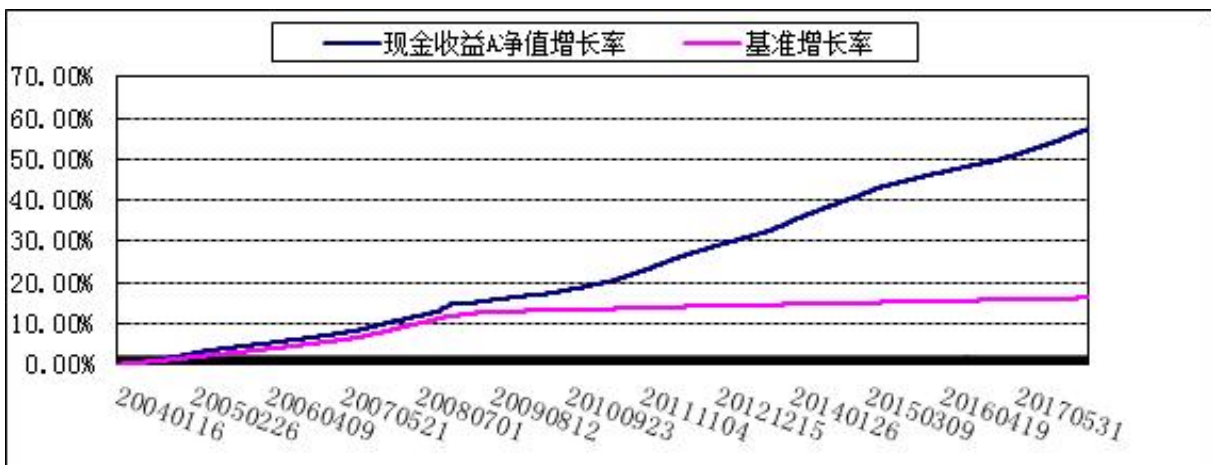
##### 2. 博时现金收益货币 B:

阶段	份额净值收 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
过去一个月	0.3213%	0.0000%	0.0292%	0.0000%	0.2921%	0.0000%
过去三个月	1.0289%	0.0010%	0.0885%	0.0000%	0.9404%	0.0010%
过去六个月	2.1168%	0.0009%	0.1760%	0.0000%	1.9408%	0.0009%
过去一年	4.1176%	0.0010%	0.3549%	0.0000%	3.7627%	0.0010%
过去三年	10.3783%	0.0021%	1.0656%	0.0000%	9.3127%	0.0021%
自基金合同生效 起至今	15.7996%	0.0030%	1.4467%	0.0000%	14.3529%	0.0030%

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）。

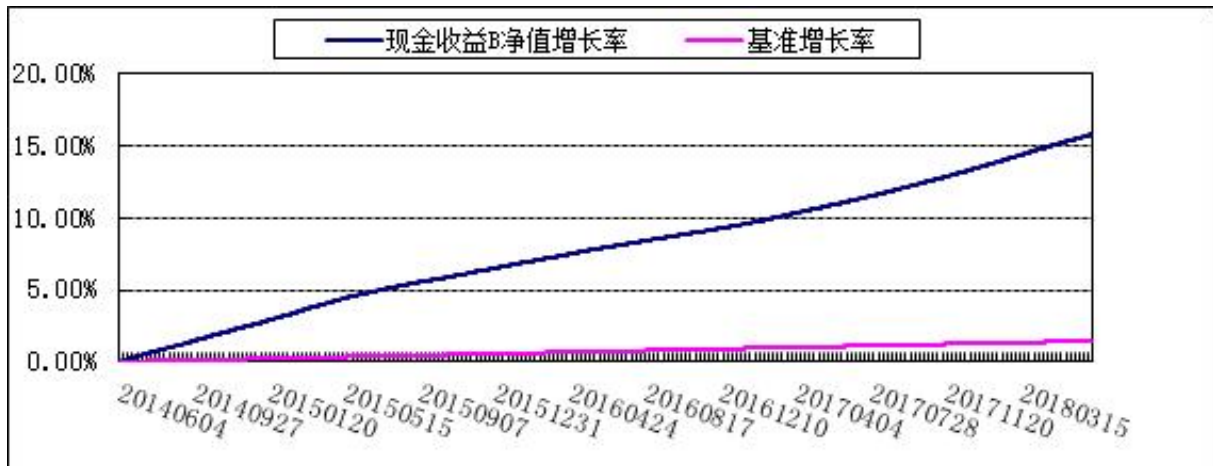
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

##### 博时现金收益货币 A



##### 博时现金收益货币 B





## § 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 2018 年 06 月 30 日，博时基金公司共管理 185 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 8461 亿元人民币，其中非货币公募基金规模逾 1947 亿元人民币，累计分红逾 872 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 2018 年 2 季末：

权益基金方面，标准指数股票型基金里，博时中证银联智慧大数据 100 指数(A 类)、博时裕富沪深 300 指数(A 类)等今年以来净值增长率同类排名为前 1/4；股票型分级子基金里，博时中证银行分级指数(B 级)等今年以来净值增长同类基金中排名为前 1/3；混合偏股型基金中，博时创业成长混合(C 类)今年以来净值增长率同类基金排名第一，博时创业成长混合(A 类)今年以来净值增长率同类基金排名位居前 1/10，博时行业轮动混合等今年以来净值增长率同类排名为前 1/3；混合灵活配置型基金中，博时裕益灵活配置混合基金今年以来净值增长率为 3.14%，在 166 只同类基金排名第 6，博时汇智回报灵活配置混合基金今年以来净值增长率为 4.38%，同类基金排名位居前 1/10，博时新价值灵活配置混合(A 类)、博时新策略灵活配置混合(A 类)、博时新起点灵活配置混合(A 类)、博时新起点灵活配置混合(C 类)今年以来净值增长率分别为 2.12%、1.93%、1.65%、1.60%，同类基金排名均位居前 1/8，博时新价值灵活配置混合(C 类)今年以来净值增长率为 2.07%，同类基金中排名位于前 1/6。

黄金基金类，博时黄金 ETF 联接(A 类)、博时黄金 ETF 联接(C 类)今年以来净值增长率同类排名第一。

固收方面，长期标准债券型基金中，博时天颐债券(A 类)、博时宏观回报债券(A/B 类)、博时信用债



券(A/B类)今年以来净值增长率为 5.11%、4.56%、4.54%，同类 219 只基金中分别排名第 3、第 8、第 9 位，博时天颐债券(C类)、博时信用债券(R类)、博时信用债券(C类)、博时宏观回报债券(C类)今年以来净值增长率分别为 4.88%、4.56%、4.34%、4.23%，同类 153 只基金中分别排名第 2、第 4、第 7、第 8 位，博时富华纯债债券、博时景兴纯债债券、博时富益纯债债券、博时裕康纯债债券、博时富发纯债债券、博时聚瑞纯债债券等今年以来净值增长率分别为 4.43%、4.10%、3.98%、3.93%、3.89%、3.88%，同类排名前 1/10；货币基金类，博时兴荣货币、博时合惠货币(A类)今年以来净值增长率分别为 2.21%、2.18%，在 315 只同类基金排名中位列第 15 位与第 24 位。

QDII 基金方面，博时标普 500ETF(QDII)、博时标普 500ETF 联接(QDII)(A类)，今年以来净值增长率同类排名分别位于前 1/5、1/4。

## 2、其他大事件

2018 年 6 月 8 日，由《中国证券报》主办的中国基金业二十周年高峰论坛暨第十五届“中国基金业金牛奖”颁奖典礼在苏州隆重举行。经过激烈且公平的票选，博时基金获得“2017 年度最受信赖金牛基金公司”荣誉称号。

2018 年 5 月 24 日，由《中国基金报》、《证券时报》主办的“第五届中国基金业英华奖、中国基金业 20 年最佳基金经理评选颁奖典礼暨高峰论坛”在深圳隆重举行。从业经历逾 23 年的博时基金副总经理兼高级投资经理董良泓荣获“中国基金业 20 年最佳基金经理”殊荣，此荣誉于全行业仅有 20 人获评；博时基金固收名将陈凯杨则凭借长期稳健的投资业绩荣膺“三年期纯债投资最佳基金经理”称号。值得一提的是，这也是陈凯杨继 2016 年之后连续两年蝉联该项殊荣，足见市场对其管理业绩的认可。

2018 年 5 月 23 日，由新浪财经和济安金信主办的“致敬公募 20 年”颁奖典礼在北京举行，公募基金老五家之一的博时基金凭借长期优良的投研业绩、雄厚的综合资管实力和对价值投资理念的一贯倡导共揽获“最佳资产管理公司”、“最受投资者欢迎基金公司”、“行业特别贡献奖”和“区域影响力奖-珠三角”这四项最具份量的公司大奖；博时基金总经理江向阳获得“行业领军人物奖”。同时，博时旗下产品博时双月薪定期支付债券基金(000277)获得“最具价值理念基金产品奖-债券型”，博时亚洲票息收益债券(QDII)(人民币 050030：，美元现汇：050202，美元现钞：050203)获得“最具投资价值基金产品奖-QDII”。

2018 年 5 月 17 日，被誉为“证券期货行业科学技术领域最高荣誉”的第六届证券期货科学技术奖的评审结果近日在北京揭晓。博时基金从上百个竞争对手中脱颖而出，一举夺得二等奖(DevOps 统一研发平台)、三等奖(证券投资基金行业核心业务软件系统统一测试)以及优秀奖(新一代基金理财综合业务接入平台)三项大奖，成为获得奖项最多的金融机构之一。

2018 年 5 月 10 日，由《上海证券报》主办的“2018 中国基金业峰会暨第十五届金基金奖颁奖典礼”在上海举行。在此次颁奖典礼上，博时基金揽获“金基金 TOP 基金公司”这一最具份量的公司大奖；博时基金权益投资总部董事总经理兼股票投资部总经理李权胜获评“金基金最佳投资回报基金经理奖”。在第 15 届金基金奖评选中，旗下价值投资典范产品博时主题行业(160505)获得“三年期金基金分红奖”。

2018 年 3 月 26 日，第十五届中国基金业金牛奖评奖结果也拉开帷幕。公募“老五家”之一的博时基金凭借长期出色的投资业绩、锐意进取的创新姿态和对价值投资的坚守一举夺得全场份量最重的“中国基金业 20 年卓越贡献公司”大奖。同时，旗下绩优产品博时主题行业混合(LOF) (160505) 荣获“2017 年度开放式混合型金牛基金”奖；博时信用债纯债债券 (050027) 荣获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2018 年 3 月 22 日，由中国基金报、香山财富论坛主办的“第五届中国机构投资者峰会暨中国基金业英华奖公募基金 20 周年特别评选、中国基金业明星基金颁奖典礼”在北京举办，本次评选中，博时基金一举斩获本届“20 周年特别评选”中最具分量的两项公司级大奖——公募基金 20 年“十大最佳基金管理人”奖和“最佳固定收益基金管理人”奖，同时，旗下明星基金博时主题行业、博时信用债券分别将“最佳回报混合型基金”奖和“最佳回报债券型基金（二级债）”奖双双收入囊中，博时聚润纯债债券则获得“2017 年度普通债券型明星基金”奖。

2018 年 2 月 2 日，由金融界举办“第二届智能金融国际论坛”暨第六届金融界“领航中国”年度盛典在南京举办，此次论坛以“安全与创新”为主题，邀请业内专家学者就现阶段行业发展的热点问题深入探讨。博时基金凭借优异的业绩与卓越的品牌影响力斩获“五年期投资回报基金管理公司奖”和“杰出品牌影响力奖”两项大奖。

2018 年 1 月 11 日，由中国基金报主办的“中国基金产品创新高峰论坛暨中国基金业 20 年最佳创新产品颁奖典礼”在上海举办。博时基金一举摘得“十大产品创新基金公司奖”，旗下产品博时主题行业混合基金 (160505) 和博时黄金 ETF 分别获得“最佳主动权益创新产品奖”和“最佳互联网创新产品奖”，成为当天最大赢家之一。

2018 年 1 月 9 日，由信息时报主办的“第六届信息时报金狮奖——2017 年度金融行业风云榜颁奖典礼”在广州隆重举行。博时基金凭借优秀的基金业绩和广泛的社会影响力荣获“年度最具影响力基金公司”大奖。

#### 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	-	12.8	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（2013.1.28-2015.9.11）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（2015.6.15-2016.7.20）、博时岁岁增利一年定期开放债券基金（2013.6.26-2016.12.15）、博时裕瑞纯债债券基金（2015.6.30-2016.12.15）、博时裕盈纯债债券基金（2015.9.29-2016.12.15）、博时裕恒纯债债券基金（2015.10.23-2016.12.15）、

					博时裕荣纯债债券基金（2015.11.6-2016.12.15）、博时裕晟纯债债券基金（2015.11.19-2016.12.27）、博时裕泰纯债债券基金（2015.11.19-2016.12.27）、博时裕丰纯债债券基金（2015.11.25-2016.12.27）、博时裕和纯债债券基金（2015.11.27-2016.12.27）、博时裕坤纯债债券基金（2015.11.30-2016.12.27）、博时裕嘉纯债债券基金（2015.12.2-2016.12.27）、博时裕达纯债债券基金（2015.12.3-2016.12.27）、博时裕康纯债债券基金（2015.12.3-2016.12.27）、博时安心收益定期开放债券基金（2012.12.6-2016.12.28）、博时裕腾纯债债券基金（2016.1.18-2017.5.8）、博时裕安纯债债券基金（2016.3.4-2017.5.8）、博时裕新纯债债券基金（2016.3.30-2017.5.8）、博时裕发纯债债券基金（2016.4.6-2017.5.8）、博时裕景纯债债券基金（2016.4.28-2017.5.8）、博时裕乾纯债债券基金（2016.1.15-2017.5.31）、博时裕通纯债债券基金（2016.4.29-2017.5.31）、博时安和 18 个月定开债基金（2016.1.26-2017.10.26）、博时安源 18 个月定开债基金（2016.6.16-2018.3.8）、博时安誉 18 个月定开债基金（2015.12.13-2018.3.15）、博时安泰 18 个月定开债基金（2016.2.4-2018.3.15）、博时安祺一年定开债基金（2016.9.29-2018.3.15）、博时安诚 18 个月定开债基金（2016.11.10-2018.5.28）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（2013.7.25-至今）、博时双月薪定期支付债券基金（2013.10.22-至今）、博时现金收益货币基金（2015.5.22-至今）、博时安瑞 18 个月定开债基金（2016.3.30-至今）、博时安怡 6 个月定开债基金（2016.4.15-至今）、博时裕弘纯债债券基金（2016.6.17-至今）、博时裕顺纯债债券基金（2016.6.23-至今）、博时裕昂纯债债券基金（2016.7.15-至今）、博时裕泉纯债债券基金（2016.9.7-至今）、博时裕信纯债债券基金（2016.10.25-至今）、博时裕诚纯债债券基金（2016.10.31-至今）、博时安康 18 个月定开债（LOF）（2017.2.17-至今）基金、博时合惠货币基金（2017.5.31-至今）、博时富益纯债债券基金（2018.5.9-至今）的基金经理。
魏桢	固定收益总	2015-05-22	-	10	2004 年起在厦门市商业银行任债券交易组

	部现金管理组投资副总监/基金经理				<p>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（2013.1.28-2015.9.11）、博时岁岁增利一年定期开放债券基金（2013.6.26-2016.4.25）、博时月月薪定期支付债券基金（2013.7.25-2016.4.25）、博时双月薪定期支付债券基金（2013.10.22-2016.4.25）、博时天天增利货币基金（2014.8.25-2017.4.26）、博时保证金货币 ETF 基金（2014.11.25-2017.4.26）、博时安盈债券基金（2015.5.22-2017.5.31）、博时产业债纯债基金（2016.5.25-2017.5.31）、博时安荣 18 个月定期开放债券基金（2015.11.24-2017.6.15）、博时聚享纯债债券基金（2016.12.19-2017.10.27）、博时安仁一年定开债基金（2016.6.24-2017.11.8）、博时裕鹏纯债债券基金（2016.12.22-2017.12.29）、博时安润 18 个月定开债基金（2016.5.20-2018.1.12）、博时安恒 18 个月定开债基金（2016.9.22-2018.4.2）、博时安丰 18 个月定期开放债券（LOF）基金（2013.8.22-2018.6.21）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月月盈短期理财债券型证券投资基金（2014.9.22-至今）、博时现金宝货币市场基金（2014.9.15-至今）、博时现金收益货币基金（2015.5.22-至今）、博时外服货币基金（2015.6.19-至今）、博时裕创纯债债券型证券投资基金（2016.5.13-至今）、博时裕盛纯债债券基金（2016.5.20-至今）、博时合利货币基金（2016.8.3-至今）、博时合鑫货币基金（2016.10.12-至今）、博时安弘一年定开债基金（2016.11.15-至今）、博时合惠货币基金（2017.5.31-至今）、博时合晶货币基金（2017.8.2-至今）、博时丰庆纯债债券基金（2017.8.23-至今）、博时兴盛货币基金（2017.12.29-至今）的基金经理。</p>
倪玉娟	基金经理助理	2015-12-21	2018-04-09	6.9	<p>2011 年至 2014 年在海通证券任固定收益分析师。2014 年加入博时基金管理有限公司，历任高级研究员、高级研究员兼基金经理助理。现任博时富瑞纯债债券型证券投资基金、博时悦梵纯债债券型证券投资基金的基金经理。</p>

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

2018 年一季度的经济数据比较强劲，工业生产和固定资产投资同比增速均好于预期，一季度 GDP 同比增速达到 6.8%。进入二季度后，部分数据出现下滑，固定资产投资完成额累计增速从一季度末的 7.50% 下行至 6.10%，基础设施建设投资（不含电力）累计同比从一季度末的 13% 跌至 9.40%，社会消费品零售总额同比从一季度末的 10.1% 降至 8.50%，但另一方面，房地产开发投资依然保持稳健，其累计同比增速基本保持在 10% 左右。因此，二季度经济基本面整体继续平稳，经济韧性依然较强，但投资数据边际放缓和中美贸易摩擦长期存在也将对经济增长构成潜在下行压力。

二季度期间，伴随资管新规、商业银行大额风险管理办法、开放式基金流动性风险管理规定等金融防风险相关的监管政策逐步落地，货币政策延续年初以来的稳健中性基调，银行间市场微观层面流动性整体依然宽松。在监管政策落地、流动性环境持续偏宽松以及经济基本面边际放缓压力增大的宏观背景下，债券资产表现较好，十年国债利率从 3.73% 下行至 3.47%，十年国开债从 4.65% 下行 40bp 至 4.25%，代表短端利率水平的一年期国开债从 3.97% 下行 30bp 至 3.67%。

货币市场方面，引发二季度流动性改善的因素较多，包括央行于 4 月和 6 月分别宣布下调存款准备金率 1 个和 0.5 个百分点、6 月份超量续作 MLF 及新增 MLF 投放等措施，使银行间流动性整体继续维持宽松。二季度期间银行间债券质押式回购 R001 和 R007 利率平均值分别为 2.73%、3.38%，与今年一季度平均值 2.68% 和 3.20% 相比，分别小幅上行 5bp 和 18bp，主要受 4 月末和 6 月末资金利率短暂走高扰动。资金利率中枢水平长期处于低位区间带动同业存单发行利率中枢下移，临近季末 3 个月股份制银行存单发行利率已回落至 3.7%，较一季度末降幅超过 25bp。



#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 基金份额净值收益率为 1.9974%，本基金 B 基金份额净值收益率为 2.1168%，同期业绩基准收益率为 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

金融紧缩对经济增长潜在负面影响在加大，基本面有回落风险。7 月份以来监管部门在信用债投资和信贷投放方面对商业银行进行窗口指导，并对资管新规和配套细则做了一定放松。展望未来，政策层面从强力去杠杆进入稳杠杆阶段，财政政策会更加积极，货币政策继续保持流动性环境合理充裕。鉴于目前货币政策传导机制不畅，银行间流动性尚需时间才能流入需要的领域，在传导机制疏通之前宽松的流动性将进一步拉低资金利率和存款、存单等货币市场工具利率。

基金根据对组合申赎规律的把握和货币市场工具利率走势的预判，合理摆布组合资产到期分布，利用货币市场利率短期冲高的窗口期配置部分仓位银行存款、同业存单等，适当调整组合平均剩余期限，维持一定杠杆操作并且根据资金面松紧情况灵活调整杠杆比例，较好地提升了组合收益。

#### 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 739,418,746.48 元，本基金 B 类本报告期内向份额持有人分配利润 239,878,512.85 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

2018 年上半年度，托管人在博时现金收益证券投资基金的托管过程中，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

2018 年上半年度，博时基金管理有限公司在博时现金收益证券投资基金投资运作、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：739,418,746.48 元，向 B 级份额持有人分配利润：239,878,512.85 元。

### 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

2018 年上半年度，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证券投资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 半年度财务会计报告（未经审计）

---

### 6.1 资产负债表

会计主体：博时现金收益证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日



单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	98,735,394,352.04	8,864,987,873.80
结算备付金		-	5,821,182.76
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	49,268,916,108.87	3,472,130,378.75
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		49,233,916,108.87	3,472,130,378.75
资产支持证券投资		35,000,000.00	-
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	15,470,881,152.37	6,835,485,703.29
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	295,326,614.83	77,428,376.60
应收股利		-	-
应收申购款		8,533,511.64	91,220,974.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	45,000.00	45,000.00
资产总计		163,779,096,739.75	19,347,119,489.74
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		11,328,046,461.71	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		41,118,807.48	4,922,683.09
应付托管费		21,845,038.42	21,650,391.57
应付销售服务费		29,895,150.23	837,522.52
应付交易费用	6.4.3.7	282,705.22	57,748.35
应交税费		4,124,722.31	4,080,249.01
应付利息		3,760,640.53	-
应付利润		15,405,075.31	2,393,327.75
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	227,490.07	856,799.50
负债合计		11,444,706,091.28	34,798,721.79
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	152,334,390,648.47	19,312,320,767.95
未分配利润	6.4.3.10	-	-
所有者权益合计		152,334,390,648.47	19,312,320,767.95
负债和所有者权益总计		163,779,096,739.75	19,347,119,489.74

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额 152,334,390,648.47 份。其中 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 146,758,609,844.07 份；B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 5,575,780,804.40 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时现金收益证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>1,175,360,963.73</b>	<b>499,072,309.05</b>
1. 利息收入		1,171,970,511.11	504,334,447.90
其中：存款利息收入	6.4.3.11	688,498,211.53	272,081,075.68
债券利息收入		353,634,342.30	211,397,032.61
资产支持证券利息收入		357,941.60	778,198.69
买入返售金融资产收入		129,480,015.68	20,078,140.92
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,882,653.12	-5,262,138.85
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	2,882,653.12	-5,262,138.85
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
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）	6.4.3.17	507,799.50	-
<b>减：二、费用</b>		<b>196,063,704.40</b>	<b>81,717,702.72</b>
1. 管理人报酬		83,119,050.10	44,450,568.36
2. 托管费		25,187,590.89	13,469,869.13
3. 销售服务费		49,396,374.70	6,558,377.75
4. 交易费用	6.4.3.18	7,550.50	-
5. 利息支出		38,056,375.32	16,959,031.66
其中：卖出回购金融资产支出		38,056,375.32	16,959,031.66
6. 税金及附加		14,073.03	-
7. 其他费用	6.4.3.19	282,689.86	279,855.82
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>979,297,259.33</b>	<b>417,354,606.33</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>979,297,259.33</b>	<b>417,354,606.33</b>

## 6.3 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	19,312,320,767.95	-	19,312,320,767.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	979,297,259.33	979,297,259.33
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）	133,022,069,880.52	-	133,022,069,880.52
其中：1. 基金申购款	421,926,924,901.92	-	421,926,924,901.92
2. 基金赎回款	-288,904,855,021.40	-	-288,904,855,021.40
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）	-	-979,297,259.33	-979,297,259.33
五、期末所有者权益（基金净值）	152,334,390,648.47	-	152,334,390,648.47
项目	上年度可比期间 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）	73,314,084,982.89	-	73,314,084,982.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	417,354,606.33	417,354,606.33
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）	-62,258,748,420.37	-	-62,258,748,420.37
其中：1. 基金申购款	43,519,870,445.87	-	43,519,870,445.87
2. 基金赎回款	-105,778,618,866.24	-	-105,778,618,866.24
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）	-	-417,354,606.33	-417,354,606.33
五、期末所有者权益（基金净值）	11,055,336,562.52	-	11,055,336,562.52

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：

 \_\_\_\_\_  
 基金管理公司负责人：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[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》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、深府办[2011]60号《深圳市地方教育附加征收管理暂行办法》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(4) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 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 2018年6月30日
活期存款	16,694,352.04
定期存款	98,718,700,000.00
其中：存款期限1个月以内	9,045,700,000.00
存款期限1-3个月	79,976,000,000.00
存款期限3个月以上	9,697,000,000.00
其他存款	-
合计	98,735,394,352.04

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 2018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	-	-	-	-
	银行间市场	49,233,916,108.87	49,271,360,000.00	37,443,891.13	0.0246
	合计	49,233,916,108.87	49,271,360,000.00	37,443,891.13	0.0246
资产支持证券		35,000,000.00	34,912,500.00	-87,500.00	-0.0001
合计		49,268,916,108.87	49,306,272,500.00	37,356,391.13	0.0245

注：1：偏离金额=影子定价-摊余成本；

2：偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值×100%。

**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**
**6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	15,470,881,152.37	-
合计	15,470,881,152.37	-

**6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无余额。

**6.4.3.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	11,863.83
应收定期存款利息	144,120,545.83
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	80,233,282.20
应收资产支持证券利息	368,679.45
应收买入返售证券利息	70,592,243.52
应收申购款利息	-
其他	-
合计	295,326,614.83

**6.4.3.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2018 年 6 月 30 日
其他应收款	45,000.00
待摊费用	-
合计	45,000.00

#### 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 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	282,705.22
合计	282,705.22

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
其他应付款	-
预提费用	227,490.07
合计	227,490.07

#### 6.4.3.9 实收基金

##### 博时现金收益货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,689,403,307.61	3,689,403,307.61
本期申购	408,885,726,927.77	408,885,726,927.77
本期赎回（以“-”号填列）	-265,816,520,391.31	-265,816,520,391.31
本期末	146,758,609,844.07	146,758,609,844.07

##### 博时现金收益货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,622,917,460.34	15,622,917,460.34
本期申购	13,041,197,974.15	13,041,197,974.15
本期赎回（以“-”号填列）	-23,088,334,630.09	-23,088,334,630.09
本期末	5,575,780,804.40	5,575,780,804.40

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

##### 博时现金收益货币 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
上年度末	-	-	-
本期利润	739,418,746.48	-	739,418,746.48

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	-739,418,746.48	-	-739,418,746.48
本期末	-	-	-

**博时现金收益货币 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
上年度末	-	-	-
本期利润	239,878,512.85	-	239,878,512.85
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	-239,878,512.85	-	-239,878,512.85
本期末	-	-	-

**6.4.3.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	77,750.14
定期存款利息收入	688,409,127.75
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,333.64
其他	-
合计	688,498,211.53

**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
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	14,421,281,459.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,395,484,220.40
减：应收利息总额	22,914,586.30
买卖债券差价收入	2,882,653.12

**6.4.3.14 衍生工具收益**

无发生额。

**6.4.3.15 股利收益**

无发生额。

**6.4.3.16 公允价值变动收益**

无发生额。



#### 6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
其他	507,799.50
合计	507,799.50

#### 6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	7,550.50
合计	7,550.50

#### 6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	69,424.36
信息披露费	148,765.71
银行划款手续费	45,599.79
中债登账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,900.00
合计	282,689.86

#### 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、基金注册登记机构、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、基金代销机构
博时资本管理有限公司（“博时资本”）	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。

#### 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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	83,119,050.10	44,450,568.36
其中：支付销售机构的客户维护费	42,927,987.84	1,946,611.39

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。

###### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	25,187,590.89	13,469,869.13

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。

###### 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		
	2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时现金收益货币 A	博时现金收益货币 B	合计
博时基金	153,158.06	550,484.00	703,642.06
交通银行	180,478.03	642.23	181,120.26
招商证券	27,926.21	1,064.63	28,990.84
合计	361,562.30	552,190.86	913,753.16
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	博时现金收益货币 A	博时现金收益货币 B	合计
博时基金	239,222.81	1,103,688.49	1,342,911.30
交通银行	219,705.38	73.66	219,779.04
招商证券	56,735.04	8,466.93	65,201.97
合计	515,663.23	1,112,229.08	1,627,892.31

注：支付基金销售机构的 A 类基金份额销售服务费按前一日 A 类基金资产净值 0.25% 的年费率计提，B 类基金份额销售服务费按前一日 B 类基金资产净值 0.01% 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 类日销售服务费 = 前一日 A 类基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

B 类日销售服务费 = 前一日 B 类基金资产净值 × 0.01% / 当年天数。

#### 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

单位：人民币元

本期 2018年1月1日至2018年6月30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	-	-	-	-	1,143,290,000.00	292,275.68
上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	-	-	-	-	2,898,950,000.00	327,980.99

#### 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	-	-	-	27,302,541.03
期间申购/买入总份额	-	395,083,547.84	16.47	1,626,808,403.73
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	395,083,547.84	-	820,000,000.00
期末持有的基金份额	-	-	16.47	834,110,944.76
期末持有的基金份额占基金 总份额比例	-	-	0.00%	11.28%

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. 基金管理人在本半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。

##### 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

#### 博时现金收益货币 A

份额单位：份

关联方名称	博时现金收益货币A本期末 2018年6月30日		博时现金收益货币A上年度末 2017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	-	-	-	-
博时资本	-	-	-	-

#### 博时现金收益货币 B

份额单位：份

关联方名称	博时现金收益货币B本期末 2018年6月30日		博时现金收益货币B上年度末 2017年12月31日	
	持有的	持有的基金份额	持有的	持有的基金份额占

	基金份额	占基金总份额的比例	基金份额	基金总份额的比例
招商证券	800,311,353.41	14.35%	-	-
博时资本	-	-	425,031,576.86	2.72%

#### 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
交通银行活期存款	16,694,352.04	77,750.14	4,393,025.09	151,284.65
交通银行定期存款	14,900,000,000.00	107,376,474.82	1,589,000,000.00	20,998,745.93

注：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。

#### 6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2018年1月1日至2018年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
交通银行	111806015	18交通银行CD015	分销发行	5,000,000	494,211,500.00
上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

#### 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

##### 博时现金收益货币 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
725,050,444.91	-	14,368,301.57	739,418,746.48	-

##### 博时现金收益货币 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
241,235,066.86	-	-1,356,554.01	239,878,512.85	-

#### 6.4.8 期末（2018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

无。

#### 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

截至本报告期末 2018 年 06 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 11,328,046,461.71 元，是以如下债券作为抵押：

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
111781410	17南京银行 CD141	2018-07-04	99.80	2,223,000.00	221,855,400.00
111807140	18招商银行 CD140	2018-07-02	97.96	5,160,000.00	505,473,600.00
111807140	18招商银行 CD140	2018-07-05	97.96	4,130,000.00	404,574,800.00
111808135	18中信银行 CD135	2018-07-02	99.53	5,100,000.00	507,603,000.00
111808135	18中信银行 CD135	2018-07-02	99.53	9,091,000.00	904,827,230.00
111808138	18中信银行 CD138	2018-07-04	99.49	1,030,000.00	102,474,700.00
111810263	18兴业银行 CD263	2018-07-05	99.20	5,710,000.00	566,432,000.00
111813031	18浙商银行 CD031	2018-07-04	98.34	1,112,000.00	109,354,080.00
111896264	18上海农商银 行CD034	2018-07-05	99.61	560,000.00	55,781,600.00
111896501	18常熟农村商 行CD032	2018-07-04	99.55	4,085,000.00	406,661,750.00
111896547	18四川天府银 行CD003	2018-07-04	99.55	2,230,000.00	221,996,500.00
130245	13国开45	2018-07-02	100.52	250,000.00	25,130,000.00
130245	13国开45	2018-07-03	100.52	1,050,000.00	105,546,000.00
140202	14国开02	2018-07-03	100.96	300,000.00	30,288,000.00
140303	14进出03	2018-07-02	100.88	233,000.00	23,505,040.00
150223	15国开23	2018-07-02	99.87	240,000.00	23,968,800.00
150223	15国开23	2018-07-02	99.87	1,060,000.00	105,862,200.00
150317	15进出17	2018-07-02	99.88	20,000.00	1,997,600.00
150317	15进出17	2018-07-04	99.88	39,000.00	3,895,320.00
160208	16国开08	2018-07-02	99.33	1,480,000.00	147,008,400.00
160208	16国开08	2018-07-03	99.33	20,000.00	1,986,600.00
170017	17付息国债17	2018-07-06	100.06	1,000,000.00	100,060,000.00
170207	17国开07	2018-07-02	99.98	1,230,000.00	122,975,400.00
170207	17国开07	2018-07-04	99.98	2,070,000.00	206,958,600.00

170211	17国开11	2018-07-02	100.15	300,000.00	30,045,000.00
170211	17国开11	2018-07-05	100.15	5,990,000.00	599,898,500.00
170410	17农发10	2018-07-04	99.94	300,000.00	29,982,000.00
170413	17农发13	2018-07-02	100.20	4,100,000.00	410,820,000.00
170413	17农发13	2018-07-03	100.20	100,000.00	10,020,000.00
180201	18国开01	2018-07-03	100.25	1,000,000.00	100,250,000.00
180201	18国开01	2018-07-03	100.25	2,800,000.00	280,700,000.00
180207	18国开07	2018-07-02	99.89	3,130,000.00	312,655,700.00
180301	18进出01	2018-07-04	100.23	3,900,000.00	390,897,000.00
180306	18进出06	2018-07-02	99.58	6,186,000.00	616,001,880.00
180306	18进出06	2018-07-05	99.58	114,000.00	11,352,120.00
180404	18农发04	2018-07-02	100.24	4,700,000.00	471,128,000.00
189916	18贴现国债16	2018-07-02	99.89	2,000,000.00	199,780,000.00
189916	18贴现国债16	2018-07-03	99.89	700,000.00	69,923,000.00
189919	18贴现国债19	2018-07-02	99.78	1,060,000.00	105,766,800.00
189919	18贴现国债19	2018-07-03	99.78	1,940,000.00	193,573,200.00
189920	18贴现国债20	2018-07-04	99.73	5,000,000.00	498,650,000.00
189921	18贴现国债21	2018-07-04	99.69	5,070,000.00	505,428,300.00
189921	18贴现国债21	2018-07-05	99.69	4,930,000.00	491,471,700.00
189922	18贴现国债22	2018-07-02	98.94	1,050,000.00	103,887,000.00
189922	18贴现国债22	2018-07-02	98.94	1,590,000.00	157,314,600.00
189922	18贴现国债22	2018-07-03	98.94	1,130,000.00	111,802,200.00
189922	18贴现国债22	2018-07-03	98.94	6,230,000.00	616,396,200.00
189923	18贴现国债23	2018-07-02	99.62	1,900,000.00	189,278,000.00
189923	18贴现国债23	2018-07-05	99.62	3,100,000.00	308,822,000.00
合计				117,743,000.00	11,722,059,820.00

#### 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及绩效分析工作，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和部分定期存款存放在本基金的托管行交通银行；其他定期存款存放在上海银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司和上海浦东发展银行股份有限公司等，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于信用等级在 AA+ 以下的债券与非金融企业债务融资工具，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。本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净值的 10%。

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 2018年6月30日	上年末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	7,663,838,980.49	988,522,039.87
合计	7,663,838,980.49	988,522,039.87

注：未评级债券为国债、政策性金融债以及短期融资券。

##### 6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。



**6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	41,090,029,532.53	2,483,608,338.88
合计	41,090,029,532.53	2,483,608,338.88

**6.4.9.2.4 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 2018年6月30日	上年末 2017年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	480,047,595.85	-
合计	480,047,595.85	-

注：未评级债券为政策性金融债。

**6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年末 2017年12月31日
AAA	35,000,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	35,000,000.00	-

**6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**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。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，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2018 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 11,328,046,461.71 元将在 1 个月内到期且计息外，本基金所持有的其他金融负债的合同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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券),并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下,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,平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 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;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天,平均剩余存续期不得超过 180 天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时,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 60 天,平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2018 年 6 月 30 日,本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为 3.14%,本基金投资组合的平均剩余期限为 63 天,平均剩余存续期为 63 天。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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。

#### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018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
<b>资产</b>					
银行存款	98,735,394,352.04	-	-	-	98,735,394,352.04
结算备付金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	43,962,573,894.27	5,306,342,214.60	-	-	49,268,916,108.87
买入返售金融资产	15,470,881,152.37	-	-	-	15,470,881,152.37
应收利息	-	-	-	295,326,614.83	295,326,614.83
应收申购款	-	-	-	8,533,511.64	8,533,511.64
其他资产	-	-	-	45,000.00	45,000.00
<b>资产总计</b>	<b>158,168,849,398.68</b>	<b>5,306,342,214.60</b>	<b>-</b>	<b>303,905,126.47</b>	<b>163,779,096,739.75</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	11,328,046,461.71	-	-	-	11,328,046,461.71
应付管理人报酬	-	-	-	41,118,807.48	41,118,807.48
应付托管费	-	-	-	21,845,038.42	21,845,038.42
应付销售服务费	-	-	-	29,895,150.23	29,895,150.23
应付交易费用	-	-	-	282,705.22	282,705.22
应交税费	-	-	-	4,124,722.31	4,124,722.31
应付利息	-	-	-	3,760,640.53	3,760,640.53
应付利润	-	-	-	15,405,075.31	15,405,075.31
其他负债	-	-	-	227,490.07	227,490.07
<b>负债总计</b>	<b>11,328,046,461.71</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>116,659,629.57</b>	<b>11,444,706,091.28</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>146,840,802,936.97</b>	<b>5,306,342,214.60</b>	<b>-</b>	<b>187,245,496.90</b>	<b>152,334,390,648.47</b>
<b>上年度末</b>					
<b>2017年12月31日</b>	<b>6个月以内</b>	<b>6个月至1年</b>	<b>1至5年</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	8,864,987,873.80	-	-	-	8,864,987,873.80
结算备付金	5,821,182.76	-	-	-	5,821,182.76
交易性金融资产	3,336,031,310.51	136,099,068.24	-	-	3,472,130,378.75
买入返售金融资产	6,835,485,703.29	-	-	-	6,835,485,703.29
应收利息	-	-	-	77,428,376.60	77,428,376.60
应收申购款	-	-	-	91,220,974.54	91,220,974.54
其他资产	-	-	-	45,000.00	45,000.00
<b>资产总计</b>	<b>19,042,326,070.36</b>	<b>136,099,068.24</b>	<b>-</b>	<b>168,694,351.14</b>	<b>19,347,119,489.74</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	4,922,683.09	4,922,683.09
应付托管费	-	-	-	21,650,391.57	21,650,391.57
应付销售服务费	-	-	-	837,522.52	837,522.52
应付交易费用	-	-	-	57,748.35	57,748.35
应交税费	-	-	-	4,080,249.01	4,080,249.01
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	2,393,327.75	2,393,327.75
其他负债	-	-	-	856,799.50	856,799.50

负债总计	-	-	34,798,721.79	34,798,721.79
利率敏感度缺口	19,042,326,070.36	136,099,068.24	133,895,629.35	19,312,320,767.95

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

#### 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 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 2,731	减少约 384
市场利率下降 25 个基点	增加约 2,737	增加约 387	

#### 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 2018 年 6 月 30 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 49,268,916,108.87 元，无属于第一或第三层次的余额（2017 年 12 月 31 日：第二层次的余额为 3,472,130,378.75 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 2018 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 (2017 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。

## § 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	49,268,916,108.87	30.08
	其中：债券	49,233,916,108.87	30.06
	资产支持证券	35,000,000.00	0.02
2	买入返售金融资产	15,470,881,152.37	9.45
	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	98,735,394,352.04	60.29
4	其他各项资产	303,905,126.47	0.19
5	合计	163,779,096,739.75	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	4.45	
	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	11,328,046,461.71	7.44
	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

本报告期内没有债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

### 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	63
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	105

报告期内投资组合平均剩余期限最低值	39
-------------------	----

**报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 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 120 天。

**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	17.13	7.44
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	60.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	11.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	6.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	11.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	107.31	7.44

**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。

**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	3,652,163,314.62	2.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,121,720,860.77	2.71
	其中：政策性金融债	4,121,720,860.77	2.71
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	370,002,400.95	0.24
6	中期票据	-	-
7	同业存单	41,090,029,532.53	26.97
8	其他	-	-
9	合计	49,233,916,108.87	32.32
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	111808135	18 中信银行 CD135	30,000,000	2,985,820,015.26	1.96



2	111803093	18 农业银行 CD093	28,000,000	2,785,613,837.66	1.83
3	111811120	18 平安银行 CD120	20,000,000	1,990,546,676.83	1.31
4	111803091	18 农业银行 CD091	20,000,000	1,989,951,946.92	1.31
5	111897470	18 北京农商银行 CD029	20,000,000	1,987,671,789.54	1.30
6	111897611	18 徽商银行 CD080	20,000,000	1,987,570,536.67	1.30
7	111807140	18 招商银行 CD140	20,000,000	1,959,184,751.20	1.29
8	111896207	18 宁波银行 CD074	15,000,000	1,494,443,110.97	0.98
9	111816150	18 上海银行 CD150	15,000,000	1,493,368,262.27	0.98
10	111821163	18 渤海银行 CD163	15,000,000	1,493,319,057.85	0.98

### 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	0.1264%
报告期内偏离度的最低值	-0.0178%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0255%

#### 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	149294	宁远 02A1	350,000.00	35,000,000.00	0.02

### 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 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。

#### 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	295,326,614.83
4	应收申购款	8,533,511.64
5	其他应收款	45,000.00
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	303,905,126.47

#### 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
博时现金收 益货币A	11,035,075	13,299.29	3,302,756,314.46	2.25%	143,455,853,529.61	97.75%
博时现金收 益货币B	49	113,791,444.99	5,488,689,604.71	98.44%	87,091,199.69	1.56%
合计	11,035,124	13,804.50	8,791,445,919.17	5.77%	143,542,944,729.30	94.23%

### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	913,647,278.12	0.60%
2	券商类机构	800,225,360.60	0.53%
3	其他机构	628,528,573.32	0.41%
4	银行类机构	511,347,090.87	0.34%
5	银行类机构	511,136,160.80	0.34%
6	银行类机构	500,160,975.09	0.33%
7	银行类机构	412,916,201.74	0.27%
8	信托类机构	300,032,242.56	0.20%
9	其他机构	102,316,307.93	0.07%
10	其他机构	102,169,465.01	0.07%

### 8.3 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	2,038,351.90	0.00%
	博时现金收益货币B	-	-
	合计	2,038,351.90	0.00%

### 8.4 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	博时现金收益货币A	50~100

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B	-
	合计	50~100
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。

## § 9 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	3,689,403,307.61	15,622,917,460.34
本报告期基金总申购份额	408,885,726,927.77	13,041,197,974.15
减：本报告期基金总赎回份额	265,816,520,391.31	23,088,334,630.09
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	146,758,609,844.07	5,575,780,804.40

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。

## § 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

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。

### 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 报告期内改聘会计师事务所情况

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

无。

### 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
国元证券	-	-	923,000,000.00	100.00%	-	-

## 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	关于博时旗下部分开放式基金增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、浙江网商银行股份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	2018-05-03
2	博时现金收益证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-04-20
3	博时现金收益证券投资基金 2017 年年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-31
4	博时现金收益证券投资基金 2017 年年度报告（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-31
5	博时现金收益证券投资基金基金契约	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-27
6	博时现金收益证券投资基金托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-27
7	流动性风险管理规定：博时现金收益证券投资基金基金契约和托管协议修改前后文对照表	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-24
8	关于博时基金管理有限公司根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》变更旗下部分基金法律文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-24
9	关于博时旗下部分开放式基金增加上海挖财金融信息服务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	2018-03-20
10	博时现金收益证券投资基金更新招募说明书 2018 年第 1 号（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-02
11	博时现金收益证券投资基金更新招募说明书 2018 年第 1 号（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-02
12	关于博时旗下部分开放式基金增加上海基煜基金销售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	2018-03-02

13	博时现金收益证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-02-09
14	关于博时旗下部分开放式基金增加成都华羿恒信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	2018-01-29
15	博时基金管理有限公司关于调整货币市场基金快速赎回额度的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-23
16	博时现金收益证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-20
17	关于博时旗下部分开放式基金增加宁夏银行股份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	2018-01-19
18	关于博时现金收益货币基金 A 类份额恢复浙商银行申购、定投及转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-05

## § 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时现金收益证券投资基金设立的文件

12.1.2 《博时现金收益证券投资基金基金合同》

12.1.3 《博时现金收益证券投资基金托管协议》

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 博时现金收益证券投资基金各年度审计报告正本

12.1.6 报告期内博时现金收益证券投资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  
二〇一八年八月二十九日