

博时合鑫货币市场基金更新招募说明书摘要

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

【重要提示】

- 1、本基金根据 2016 年 6 月 24 日中国证券监督管理委员会《关于准予博时合鑫货币市场基金注册的批复》（证监许可[2016]1407 号）准予注册。
- 2、基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。
- 3、本基金投资于货币市场，每万份基金净收益会因为货币市场波动等因素产生波动。投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，中国人民银行的利率调整和市场利率的波动构成本基金的利率风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险及本基金的特定风险等。本基金为货币市场基金，属于低预期风险、低预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益均低于股票型基金、混合型基金及债券型基金。
- 4、基金管理人因违反基金合同及相关业务规则规定导致流动性管理不善而引起交收违约，导致停止申购赎回业务，造成投资者损失由基金管理人承担。
- 5、投资有风险，投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》、基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，自主判断基金的投资价值并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策，自行承担投资风险。
- 6、基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。
- 7、基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。
- 8、基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。
- 9、本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2017 年 4 月 12 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：博时基金管理有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

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

法定代表人：张光华

成立时间：1998 年 7 月 13 日

注册资本：2.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：韩强

联系电话：（0755）8316 9999

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准设立。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份 49%；中国长城资产管理公司，持有股份 25%；天津港（集团）有限公司，持有股份 6%；上海汇华实业有限公司，持有股份 12%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份 6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份 2%。注册资本为 2.5 亿元人民币。

公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设两大总部和二十八个直属部门，分别是：权益投资总部、固定收益总部以及宏观策略部、交易部、指数与量化投资部、特定资产管理部、多元资产管理部、年金投资部、产品规划部、营销服务部、客户服务中心、市场部、养老金业务中心、战略客户部、机构-上海、机构-南方、券商业务部、零售-北京、零售-上海、零售-南方、央企业务部、互联网金融部、董事会办公室、办公室、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、风险管理部和监察法律部。

权益投资总部负责公司所管理资产的权益投资管理及相关工作。权益投资总部下设股票投资部（含各投资风格小组）、研究部。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。研究部负责完成对宏观经济、投资策略、行业上市公司及市场的研究。固定收益总部负责公司所管理资产的固定收益投资管理及相关工作。固定收益总部下设现金管理组、公募基金组、专户组、国际组和研究组，分别负责各类固定收益资产的研究和投资工作。

市场部负责公司市场和销售管理、销售组织、目标和费用管理、销售督导与营销培训管理、公司零售渠道银行总行管理与维护、推动金融同业业务合作与拓展、国际业务的推动与协作等工作。战略客户部负责北方地区由国资委和财政部直接管辖企业以及该区域机构客户的销售与服务工作。机构-上海和机构-南方分别主要负责华东地区、华南地区以及其他指定区域的机构客户销售与服务工作。养老金业务中心负责公司社保基金、企业年金、基本养老金及职业年金的客户拓展、销售与服务、养老金研究与政策咨询、养老金销售支持与中台运作协调、相关信息服务等工作。券商业务部负责券商渠道的开拓和销售服务。零售-北京、零售-上海、零售-南方负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。央企业务部负责招商局集团签约机构客户、重要中央企业及其财务公司等客户的拓展、合作业务落地与服务等工作。营销服务部负责营销策划、销售支持、品牌传播、对外媒体宣传等工作。

宏观策略部负责为投委会审定资产配置计划提供宏观研究和策略研究支持。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。指数与量化投资部负责公司各类指数与量化投资产品的研究和投资管理工作。特定资产管理部负责公司权益类特定资产专户和权益类社保投资组合的投资管理及相关工作。多元资产管理部负责公司的基金中基金投资

产品的研究和投资管理等工作。年金投资部负责公司所管理企业年金等养老金资产的投资管理及相关工作。产品规划部负责新产品设计、新产品报批、主管部门沟通维护、产品维护以及年金方案设计等工作。互联网金融部负责公司互联网金融战略规划的设计和实施，公司互联网金融的平台建设、业务拓展和客户运营，推动公司相关业务在互联网平台的整合与创新。客户服务中心负责零售客户的服务和咨询工作。

董事会办公室专门负责股东会、董事会、监事会及董事会各专业委员会各项会务工作；股东关系管理与董、监事的联络、沟通及服务；基金行业政策、公司治理、战略发展研究、公司文化建设；与公司治理及发展战略等相关的重大信息披露管理；政府公共关系管理；党务工作；博时慈善基金会的管理及运营等。办公室负责公司的行政后勤支持、会议及文件管理、外事活动管理、档案管理及工会工作等。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、员工沟通、人力资源信息管理工作。财务部负责公司预算管理、财务核算、成本控制、财务分析等工作。信息技术部负责信息系统开发、网络运行及维护、IT 系统安全及数据备份等工作。基金运作部负责基金会计和基金注册登记等业务。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。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察，并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。

另设北京分公司、上海分公司、沈阳分公司、郑州分公司和成都分公司，分别负责对驻京、沪、沈阳、郑州和成都人员日常行政管理和对赴京、沪、沈阳和郑州处理公务人员给予协助。此外，还设有全资子公司博时资本管理有限公司，以及境外子公司博时基金（国际）有限公司。

截止到 2016 年 12 月 31 日，公司总人数为 498 人，其中研究员和基金经理超过 88% 拥有硕士及以上学历。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

二、主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

张光华先生，博士，董事长。历任国家外汇管理局政研室副主任，计划处处长，中国人民银行海南省分行副行长、党委委员，中国人民银行广州分行副行长、党委副书记，广东发展银行行长、党委副书记，招商银行副行长、执行董事、副董事长、党委副书记，在招商银行任职期间曾兼任永隆银行副董事长、招商基金管理有限公司董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长、招银国际金融有限公司董事长、招银金融租赁有限公司董事长。

2015 年 8 月起，任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人。

熊剑涛先生，硕士，工程师，董事。1992 年 5 月至 1993 年 4 月任职于深圳山星电子有限公司。1993 年起，历任招商银行总行电脑部信息中心副经理，招商证券股份有限公司电脑部副经理、经理、电脑中心总经理、技术总监兼信息技术中心总经理；2004 年 1 月至 2004 年 10 月，被中国证监会借调至南方证券行政接管组任接管组成员；2005 年 12 月起任招商证券股份有限公司副总裁，现分管经纪业务、资产管理业务、信息技术中心，兼任招商期货有限公司董事长、中国证券业协会证券经纪专业委员会副主任委员。2014 年 11 月起，任博时基金管理有限公司第六届董事会董事。

江向阳先生，董事。2015 年 7 月起任博时基金管理有限公司总经理。中共党员，南开大学国际金融博士，清华大学金融媒体 EMBA。1986-1990 年就读于北京师范大学信息与情报学系，获学士学位；1994-1997 年就读于中国政法大学研究生院，获法学硕士学位；2003-2006 年，就读于南开大学国际经济研究所，获国际金融博士学位。2015 年 1 月至 7 月，

任招商局金融集团副总经理、博时基金管理有限公司党委副书记。历任中国证监会办公厅、党办副主任兼新闻办（网信办）主任；中国证监会办公厅副巡视员；中国证监会深圳专员办处长、副专员；中国证监会期货监管部副处长、处长；中国农业工程研究设计院情报室干部。

王金宝先生，硕士，董事。1988年7月至1995年4月在上海同济大学数学系工作，任教师。1995年4月进入招商证券，先后任上海澳门路营业部总经理、上海地区总部副总经理（主持工作）、投资部总经理、投资部总经理兼固定收益部总经理、股票销售交易部总经理（现更名为机构业务总部）、机构业务董事总经理。2002年10月至2008年7月，任博时基金管理有限公司第二届、第三届监事会监事。2008年7月起，任博时基金管理有限公司第四届至第六届董事会董事。

陈克庆先生，北京大学工商管理硕士。2001年起历任世纪证券投资银行北京总部副总经理，国信证券投行业务部副总经理，华西证券投资银行总部副总经理、董事总经理。2014年加入中国长城资产管理公司，现任投资投行事业部副总经理。

杨林峰先生，硕士，高级经济师，董事。1988年8月就职于国家纺织工业部，1992年7月至2006年6月任职于中国华源集团有限公司，先后任华源发展股份有限公司（上海证交所上市公司）董秘、副总经理、常务副总经理等职。2006年7月就职于上海市国资委直属上海大盛资产有限公司，任战略投资部副总经理。2007年10月至今，出任上海盛业股权投资基金有限公司执行董事、总经理。2011年7月至2013年8月，任博时基金管理有限公司第五届监事会监事。2013年8月起，任博时基金管理有限公司第五届、第六届董事会董事。

顾立基先生，硕士，独立董事。1968年至1978年就职于上海印染机械修配厂，任共青团总支书记；1983年起，先后任招商局蛇口工业区管理委员会办公室秘书、主任；招商局蛇口工业区免税品有限公司董事总经理；中国国际海运集装箱股份有限公司董事副总经理、总经理；招商局蛇口工业区有限公司副总经理、国际招商局贸易投资有限公司董事副总经理；蛇口招商港务股份有限公司董事总经理；招商局蛇口工业区有限公司董事总经理；香港海通有限公司董事总经理；招商局科技集团有限公司董事总经理、招商局蛇口工业区有限公司副总经理。2008年退休。2008年2月至今，任清华大学深圳研究生院兼职教授；2008年11月至2010年10月，兼任招商局科技集团有限公司执行董事；2009年6月至今，兼任中国平安保险（集团）股份有限公司外部监事、监事会主席；2011年3月至今，兼任湘电集团有限公司外部董事；2013年5月至2014年8月，兼任德华安顾人寿保险有限公司（ECNL）董事；2013年6月至今，兼任深圳市昌红科技股份有限公司独立董事。2014年11月起，任博时基金管理有限公司第六届董事会独立董事。

李南峰先生，学士，独立董事。1969年起先后在中国人民解放军酒泉卫星基地、四川大学经济系、中国人民银行、深圳国际信托投资公司、华润深国投信托有限公司工作，历任中国人民银行总行金融研究所研究院、深圳特区人行办公室主任，深圳国际信托投资公司副总经理、总经理、董事长、党委书记，华润深国投信托有限公司总经理、副董事长。1994年至2008年曾兼任国信证券股份有限公司董事、董事长。2010年退休。2013年8月起，任博时基金管理有限公司第五届、第六届董事会独立董事。

何迪先生，硕士，独立董事。1971年起，先后在北京西城区半导体器件厂、北京东城区电子仪器一厂、中共北京市委党校、社科院美国研究所、加州大学伯克利分校、布鲁津斯学会、标准国际投资管理公司工作。1997年9月至今任瑞银投资银行副主席。2008年1月，何迪先生建立了资助、支持中国经济、社会与国际关系领域中长期问题研究的非营利公益组织“博源基金会”，并担任该基金会总干事。2012年7月起，任博时基金管理有限公司第五届、第六届董事会独立董事。

2、基金管理人监事会成员

车晓昕女士，硕士，监事。1983年起历任郑州航空工业管理学院助教、讲师、珠海证券有限公司经理、招商证券股份有限公司投资银行总部总经理。现任招商证券股份有限公司财务管理董事总经理。2008年7月起，任博时基金管理有限公司第四至六届监事会监事。

余和研先生，监事。1974年12月入伍服役。自1979年4月进入中国农业银行总行工作，先后在办公室、农村金融研究所、发展研究部、国际业务部等部门担任科员、副处长、处长等职务；1993年8月起先后在英国和美国担任中国农业银行伦敦代表处首席代表、纽约代表处首席代表；1998年8月回到中国农业银行总行，在零售业务部担任副总经理。

1999年10月起到中国长城资产管理公司工作，先后在总部国际业务部、人力资源部担任总经理；2008年8月起先后到中国长城资产管理公司天津办事处、北京办事处担任总经理；2014年3月至今担任中国长城资产管理公司控股的长城国富置业有限公司监事、监事会主席，长城环亚国际投资有限公司董事；2015年7月起任博时基金管理有限公司监事。

赵兴利先生，硕士，监事。1987年至1995年就职于天津港务局计财处。1995年至2012年5月先后任天津港贸易公司财务科科长、天津港货运公司会计主管、华夏人寿保险股份有限公司财务部总经理、天津港财务有限公司常务副总经理。2012年5月筹备天津港（集团）有限公司金融事业部，2011年11月至今任天津港（集团）有限公司金融事业部副部长。2013年3月起，任博时基金管理有限公司第五至六届监事会监事。

郑波先生，博士，监事。2001年起先后在中国平安保险公司总公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司人力资源部总经理。2008年7月起，任博时基金管理有限公司第四至六届监事会监事。

黄健斌先生，工商管理硕士。1995年起先后在广州证券有限公司、广发基金管理有限责任公司投资管理部、中银国际基金管理有限公司基金管理部工作。2005年加入博时基金管理有限公司，历任固定收益部基金经理、博时平衡配置混合型基金经理、固定收益部副总经理、社保组合投资经理、固定收益部总经理。现任公司总经理助理兼固定收益部董事总经理、年金投资部总经理、社保组合投资经理、高级投资经理、兼任博时资本管理有限公司董事。2016年3月18日至今担任博时基金管理有限公司监事会监事。

严斌先生，硕士，监事。1997年7月起先后在华侨城集团公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司财务部副总经理。2015年5月起，任博时基金管理有限公司第六届监事会监事。

3、高级管理人员

张光华先生，简历同上。

江向阳先生，简历同上。

王德英先生，硕士，副总经理。1995年起先后在北京清华计算机公司任开发部经理、清华紫光股份公司CAD与信息事业部任总工程师。2000年加入博时基金管理有限公司，历任行政管理部副经理，电脑部副经理、信息技术部总经理、公司代总经理。现任公司副总经理，主管IT、运作、指数与量化投资等工作，博时基金(国际)有限公司及博时资本管理有限公司董事。

董良泓先生，CFA，MBA，副总经理。1993年起先后在中国技术进出口总公司、中技上海投资公司、融通基金管理有限公司、长城基金管理有限公司从事投资管理工作。2005年2月加入博时基金管理有限公司，历任社保股票基金经理，特定资产高级投资经理，研究部总经理兼特定资产高级投资经理、社保股票基金经理、特定资产管理部总经理、博时资本管理有限公司董事。现任公司副总经理兼高级投资经理、社保组合投资经理，兼任博时基金（国际）有限公司董事。

邵凯先生，经济学硕士，副总经理。1997年至1999年在河北省经济开发投资公司从事投

资管理工作。2000年8月加入博时基金管理有限公司，历任债券组合经理助理、债券组合经理、社保债券基金基金经理、固定收益部副总经理兼社保债券基金基金经理、固定收益部总经理、固定收益投资总监、社保组合投资经理。现任公司副总经理、兼任博时基金（国际）有限公司董事、博时资本管理有限公司董事。

徐卫先生，硕士，副总经理。1993年起先后在深圳市证券管理办公室、中国证监会、摩根士丹利华鑫基金工作。2015年6月加入博时基金管理有限公司，现任公司副总经理兼博时资本管理有限公司董事。

孙麒清女士，商法学硕士，督察长。曾供职于广东深港律师事务所。2002年加入博时基金管理有限公司，历任监察法律部法律顾问、监察法律部总经理。现任公司督察长，兼任博时基金（国际）有限公司董事、博时资本管理有限公司副董事长。

4、本基金基金经理

魏桢女士，学士。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（2013年8月22日至今）、博时天天增利货币市场基金（2014年8月25日至今）、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金（2014年9月22日至今）、博时现金宝货币市场基金（2014年9月18日至今）、博时现金收益货币基金（2015年5月22日至今）、博时安盈债券基金（2015年5月22日至今）、博时保证金货币ETF基金（2015年6月8日至今）、博时外服货币基金（2015年6月19日至今）、博时安荣18个月定期开放债券基金（2015年11月24日至今）、博时裕创纯债债券型证券投资基金（2016年05月13日至今）、博时安润18个月定开债基金（2016年05月20日至今）、博时裕盛纯债债券基金（2016年05月20日至今）、博时产业债纯债基金（2016年5月25日至今）、博时安仁一年定开债基金（2016年06月24日至今）、博时合利货币基金（2016年08月03日至今）、博时安恒18个月定开债基金（2016年09月22日至今）、博时合鑫货币基金（2016年10月12日至今）、博时安弘一年定开债基金（2016年11月15日至今）、博时聚享纯债债券基金（2016年12月19日至今）、博时裕鹏纯债债券基金（2016年12月22日至今）的基金经理。

5、投资决策委员会成员

委员：江向阳、邵凯、黄健斌、李权胜、欧阳凡、魏凤春、王俊、过钧、白仲光

江向阳先生，简历同上。

邵凯先生，简历同上。

黄健斌先生，简历同上。

李权胜先生，硕士。2001年起先后在招商证券、银华基金工作。2006年加入博时基金管理有限公司，历任研究员、研究员兼基金经理助理、特定资产投资经理、特定资产管理部副总经理、博时医疗保健行业股票基金基金经理、股票投资部副总经理、股票投资部成长组投资总监。现任股票投资部总经理兼价值组投资总监、博时精选混合基金、博时新趋势混合基金的基金经理。

欧阳凡先生，硕士。2003年起先后在衡阳市金杯电缆厂、南方基金工作。2011年加入博时基金管理有限公司，曾任特定资产管理部副总经理、社保组合投资经理助理。现任特定资产管理部总经理兼社保组合投资经理。

魏凤春先生，经济学博士。1993年起先后在山东经济学院、江南证券、清华大学、江南证券、中信建投证券公司工作。2011年加入博时基金管理有限公司，历任投资经理、博时抗通胀增强回报（QDII-FOF）基金、博时平衡配置混合基金的基金经理。现任首席宏观策略

分析师兼宏观策略部总经理、多元资产管理部总经理。

王俊先生，硕士，CFA。2008年从上海交通大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、金融地产与公用事业组组长、研究部副总经理、博时国企改革股票基金、博时丝路主题股票基金的基金经理。现任研究部总经理兼博时主题行业混合(LOF)基金、博时沪港深优质企业混合基金、博时沪港深成长企业混合基金、博时沪港深价值优选混合基金的基金经理。

过钧先生，硕士，CFA。1995年起先后在上海工艺品进出口公司、德国德累斯顿银行上海分行、美国Lowe's食品有限公司、美国通用电气公司、华夏基金固定收益部工作。2005年加入博时基金管理有限公司，历任基金经理、博时稳定价值债券投资基金的基金经理、固定收益部副总经理、博时转债增强债券型证券投资基金、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金、博时裕祥分级债券型证券投资基金、博时双债增强债券型证券投资基金、博时新财富混合型证券投资基金的基金经理。现任董事总经理兼固定收益总部公募基金组投资总监、博时信用债券投资基金、博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)、博时新收益灵活配置混合型证券投资基金、博时新机遇混合型证券投资基金、博时新价值灵活配置混合型证券投资基金、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金、博时鑫源灵活配置混合型证券投资基金、博时乐臻定期开放混合型证券投资基金、博时新起点灵活配置混合型证券投资基金、博时双债增强债券型证券投资基金、博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金、博时鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

白仲光先生，博士。1991年起先后在石家庄无线电九厂、石家庄经济学院、长盛基金、德邦基金、上海金珀资产管理公司工作。2015年加入博时基金管理有限公司，现任年金投资部投资总监兼股票投资部绝对收益组投资总监。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

(一) 基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2016年9月30日，本集团总资产55,639.90亿元人民币，高级法下资本充足率14.16%，

权重法下资本充足率 12.73%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室 5 个职能处室，现有员工 60 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

经过十四年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2016 年招商银行加大高收益托管产品营销力度，截至 12 月末新增托管公募开放式基金 105 只，新增首发公募开放式基金托管规模 827.91 亿元。克服国内证券市场震荡的不利形势，托管费收入、托管资产均创出历史新高，实现托管费收入 44.04 亿元，同比增长 23.48%，托管资产余额 10.17 万亿元，同比增长 42.1%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人，成功签约“壹基金”公益资金托管，为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索，该项目荣获 2012 中国金融品牌「金象奖」“十大公益项目”奖；四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。

2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获奖项国内托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7 月荣膺 2016 年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”。

（二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014 年 7 月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013 年 5 月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

丁伟先生，本行副行长。大学本科毕业，副研究员。1996 年 12 月加入本行，历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理，杭州分行行长助理、副行长，南昌支行行长，南昌分行行长，总行人力资源部总经理，总行行长助理，2008 年 4 月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任

职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）基金托管业务经营情况

截至2016年12月31日，招商银行股份有限公司累计托管256只开放式基金及其它托管资产，托管资产为10.17万亿元人民币。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

(1)招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83198888

传真：0755-83195049

客户服务电话：95555

网址：<http://www.cmbchina.com/>

(2)晋商银行股份有限公司

注册地址：山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦

办公地址：山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦

法定代表人：上官永清

联系人：董嘉文

电话：0351-6819579

传真：0351-6819926

客户服务电话：95105588

网址：<http://www.jshbank.com>

(3)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址：北京市西城区金融大街35号国企大厦C座9层

法定代表人：杨懿

联系人：张燕

电话：010-58325388

传真：010-58325300

客户服务电话： 400-166-1188

网址： <http://8.jrj.com.cn/>

(4)和讯信息科技有限公司

注册地址： 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址： 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人： 王莉

联系人： 张紫薇

电话： 0755-82721122-8625

传真： 0755-82029055

客户服务电话： 400-920-0022

网址： <http://Licaike.hexun.com>

(5)诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址： 上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址： 上海浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室

法定代表人： 汪静波

联系人： 方成

电话： 021-38602377

传真： 021-38509777

客户服务电话： 400-821-5399

网址： <http://www.noah-fund.com>

(6)深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址： 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址： 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人： 薛峰

联系人： 童彩平

电话： 0755-33227950

传真： 0755-33227951

客户服务电话： 400-678-8887

网址： <https://www.zlfund.cn/>; www.jjmmw.com

(7)上海天天基金销售有限公司

注册地址： 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址： 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人： 其实
联系人： 潘世友
电话： 021-54509998
传真： 021-64385308
客户服务电话： 400-181-8188
网址： <http://www.1234567.com.cn>

(8)蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址： 杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室
办公地址： 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼
法定代表人： 陈柏青
联系人： 朱晓超
电话： 021-60897840
传真： 0571-26697013
客户服务电话： 400-076-6123
网址： <http://www.fund123.cn>

(9)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址： 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
办公地址： 上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层
法定代表人： 张跃伟
联系人： 敖玲
电话： 021-58788678-8201
传真： 021-58787698
客户服务电话： 400-820-2899
网址： <http://www.erichfund.com>

(10)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址： 杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室
办公地址： 浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼
法定代表人： 凌顺平
联系人： 吴杰
电话： 0571-88911818
传真： 0571-86800423
客户服务电话： 400-877-3772
网址： www.5ifund.com

(11)嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元

办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层

法定代表人：赵学军

联系人：余永健

电话：010-85097570

传真：010-65215433

客户服务电话：400-021-8850

网址：www.harvestwm.cn

(12)深圳腾元基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1808

办公地址：深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1808

法定代表人：曾革

联系人：鄢萌莎

电话：0755-33376922

传真：0755-33065516

客户服务电话：400-990-8600

网址：www.tenyuanfund.com

(13)北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层

法定代表人：周斌

联系人：马鹏程

电话：010-57756074

传真：010-56810782

客户服务电话：400-786-8868

网址：<http://www.chtfund.com>

(14)北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

电话：010-56282140

传真：010-62680827

客户服务电话： 400-619-9059

网址： www.fundzone.cn

(15)海银基金销售有限公司

注册地址： 上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

办公地址： 上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼

法定代表人： 刘惠

联系人： 毛林

电话： 021-80133597

传真： 021-80133413

客户服务电话： 400-808-1016

网址： www.fundhaiyin.com

(16)北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址： 北京市海淀区北四环西路 58 号 906 室

办公地址： 北京市海淀区北四环西路 58 号 906 室、903 室

法定代表人： 张琪

联系人： 付文红

电话： 010-82628888-5657

传真： 010-82607516

客户服务电话： 010-62675369

网址： www.xincai.com

(17)上海万得投资顾问有限公司

注册地址： 中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址： 中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 8 楼

法定代表人： 王廷富

联系人： 姜吉灵

电话： 021-5132 7185

传真： 021-6888 2281

客户服务电话： 400-821-0203

网址：

(18)北京微动利投资管理有限公司

注册地址： 北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

办公地址： 北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

法定代表人： 梁洪军
联系人： 季长军
电话： 010-52609656
传真： 010-51957430
客户服务电话： 400-819-6665
网址： www.buyforyou.com.cn

(19)上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址： 上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室
办公地址： 上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦四楼
法定代表人： 陈继武
联系人： 李晓明
电话： 021-63333319
传真： 021-63332523
客户服务电话： 400-643-3389
网址： www.lingxianfund.com

(20)深圳富济财富管理有限公司
注册地址： 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室
办公地址： 深圳市南山区高新南七道惠恒集团二期 418 室
法定代表人： 齐小贺
联系人： 陈勇军
电话： 0755-83999907
传真： 0755-83999926
客户服务电话： 0755-83999913
网址： www.jinqianwo.cn

(21)上海陆金所资产管理有限公司
注册地址： 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
办公地址： 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼
法定代表人： 郭坚
联系人： 宁博宇
电话： 021-20665952
传真： 021-22066653
客户服务电话： 400-821-9031
网址： www.lufunds.com

(22)珠海盈米财富管理有限公司

注册地址： 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址： 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人： 肖雯

联系人： 吴煜浩

电话： 020-89629099

传真： 020-89629011

客户服务电话： 020-80629066

网址： www.yingmi.cn

(23)和耕传承基金销售有限公司

注册地址： 郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦 602

办公地址： 郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦 602

法定代表人： 李淑慧

联系人： 裴小龙

电话： 0371-85518391

传真： 0371-85518397

客户服务电话： 0371-85518396

网址： <http://www.chuanchengcaifu.com/>

(24)大连网金金融信息服务有限公司

注册地址： 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号 2 层 202 室

办公地址： 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号 2 层 202 室

法定代表人： 卜勇

联系人： 卜勇

电话： 0411-39027800

传真： 0411-39027888

客户服务电话： 400-089-9100

网址： <http://www.yibaijin.com/>

(25)深圳市金斧子投资咨询有限公司

注册地址： 深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼

办公地址： 深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼

法定代表人： 赖任军

联系人： 张焯

电话： 0755-66892301

传真： 0755-66892399

客户服务电话： 400-950-0888

网址： www.jfzinv.com

(26)北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址： 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址： 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人： 钟斐斐

联系人： 戚晓强

电话： 15810005516

传真： 010-85659484

客户服务电话： 400-061-8518

网址： danjuanapp.com

(27)深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

注册地址： 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址： 深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A

法定代表人： 高锋

联系人： 李勇

电话： 0755-83655588

传真： 0755-83655518

客户服务电话： 400-804-8688

网址： www.keynesasset.com

基金销售机构的具体名单见基金份额发售公告，基金管理人可依据实际情况增减、变更基金销售机构。

基金管理人可根据有关法律法规，变更、增减发售本基金的销售机构，并及时公告。

二、登记机构

名称： 博时基金管理有限公司

住所： 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

办公地址： 北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

法定代表人： 张光华

电话： 010-65171166

传真： 010-65187068

联系人： 许鹏

三、出具法律意见书的律师事务所

名称： 上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

电话：021- 31358666

传真：021- 31358600

负责人：俞卫锋

联系人：安冬

经办律师：安冬、陆奇

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：张振波

经办注册会计师：薛竞、张振波

第四部分 基金的名称

博时合鑫货币市场基金

第五部分 基金的类型

本基金运作方式为契约型开放式，存续期间为不定期。

第六部分 基金的投资目标

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。

第七部分 基金的投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

第八部分 基金的投资策略

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。

1、利率策略

本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究主要经济变量指标、分析宏观经济情况，建立经济前景的情景模拟，进而判断财政政策、货币政策等宏观经济政策取向。同时，本基金还将分析金融市场资金供求状况变化趋势，对影响资金面的因素进行详细分析与预判，建立资金面的场景模拟。

在宏观分析与流动性分析的基础上，结合历史与经验数据，确定当前资金的时间价值、通货膨胀补偿、流动性溢价等要素，得到当前宏观与流动性条件下的均衡收益率曲线。区分当前利率债收益率曲线期限利差、曲率与券间利差所面临的历史分位，然后通过市场收益率曲线与均衡收益率曲线的对比，判断收益率曲线参数变动的程度和概率，确定组合的平

均剩余期限，并据此动态调整投资组合。

2、骑乘策略

当市场利率期限结构向上倾斜并且相对较陡时，投资并持有债券一段时间，随着时间推移，债券剩余年限减少，市场同样年限的债券收益率较低，这时将债券按市场价格出售，投资人除了获得债券利息以外，还可以获得资本利得。在多数情况下，这样的骑乘操作策略可以获得比持有到期更高的收益。

3、放大策略

放大策略即以组合现有债券为基础，利用买断式回购、质押式回购等方式融入资金，并购买剩余年限相对较长的债券，以期获取超额收益的操作方式。在回购利率过高、流动性不足、或者市场状况不宜采用放大策略等情况下，本基金将适时降低杠杆投资比例。

4、信用债投资策略

(1)信用风险控制。本基金拟投资的每支信用债券必需经过博时基金债券信用评级系统进行内部评级，符合基金所对应的内部评级规定的方可进行投资，以事前防范和控制信用风险。

(2)信用利差策略。信用产品相对国债、政策性金融债等利率产品的信用利差是获取较高投资收益的来源。首先，伴随经济周期的波动，在经济周期上行或下行阶段，信用利差通常会缩小或扩大，利差的变动会带来趋势性的信用产品投资机会。同时，研究不同行业在经济周期和政策变动中所受的影响，以确定不同行业总体信用风险和利差水平的变动情况，投资具有积极因素的行业，规避具有潜在风险的行业。其次，信用产品发行人资信水平和评级调整的变化会使产品的信用利差扩大或缩小，本基金将充分发挥内部评级在定价方面的作用，选择评级有上调可能的信用债，以获取因利差下降带来的价差收益。第三，对信用利差期限结构进行研究，分析各期限信用债利差水平相对历史平均水平所处的位置，以及不同期限之间利差的相对水平，发现更具投资价值的期限进行投资；第四，研究分析相同期限但不同信用评级债券的相对利差水平，发现偏离均值较多、相对利差有收窄可能的债券。

(3)类属选择策略。国内信用产品目前正经历着快速发展阶段，不同审批机构批准发行的信用产品在定价、产品价格特性、信用风险方面具有一定差别，本基金将考虑产品定价的合理性、产品主要投资人的需求特征、不同类属产品的持有收益和价差收益特点和实际信用风险状况，进行信用债券的类属选择。

5、资产支持证券投资策略

当前国内资产支持证券市场以信贷资产证券化产品为主（包括以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产），仍处于创新试点阶段。产品投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

第九部分 业绩比较基准

活期存款利率(税后)。

本基金定位为现金管理工具，注重基金资产的流动性和安全性，因此采用活期存款利率（税后）作为业绩比较基准。活期存款利率由中国人民银行公布，如果活期存款利率或利息税发生调整，则新的业绩比较基准将从调整当日起开始生效。

如果今后法律法规发生变化，或者中国人民银行调整或停止该基准利率的发布，或者市场中出现其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，

而无需召开基金份额持有人大会。

第十部分 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均低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

第十一部分 基金投资组合报告

博时基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 固定收益投资 8,464,871,054.79 20.42

其中：债券 8,464,871,054.79 20.42

资产支持证券 --

2 买入返售金融资产 963,620,605.43 2.33

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 31,873,359,115.72 76.91

4 其他各项资产 142,954,371.23 0.34

5 合计 41,444,805,147.17 100.00

2 报告期债券回购融资情况

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 0.04

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 --

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%。

3 基金投资组合平均剩余期限

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 20

报告期内投资组合平均剩余期限最高值 45

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 18

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限没有超过 120 天的情况。

3.2 报告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 90.43 0.03

其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 --

2 30天(含)—60天 5.53 -

其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 --

3 60天(含)—90天 0.31

-

其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 --

4 90天(含)—120天 2.72 -

其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 --

5 120天(含)—397天(含) 0.69 -

其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 --

合计 99.68 0.03

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期限未超过240天

5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 326,078,944.44 0.79

2 央行票据 --

3 金融债券 1,750,146,989.40 4.22

其中：政策性金融债 1,750,146,989.40 4.22

4 企业债券 --

5 企业短期融资券 --

6 中期票据 --

7 同业存单 6,388,645,120.95 15.42

8 其他 --

9 合计 8,464,871,054.79 20.43

10 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 --

6 报告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

序号 债券代码 债券名称 债券数量

(张) 摊余成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 111703018 17 农业银行 CD018 30,000,000.00 2,994,360,449.78 7.23

2 111703017 17 农业银行 CD017 24,000,000.00 2,395,633,957.67 5.78

3 160414 16 农发 14 5,700,000.00 569,942,340.61 1.38

4 111793492 17 深圳前海微众银行 CD009 5,000,000.00 499,446,477.24 1.21

5 111793780 17 九江银行 CD058 5,000,000.00 499,204,236.26 1.20

6 140208 14 国开 08 4,200,000.00 420,177,476.52 1.01

7 019546 16 国债 18 2,865,000.00 286,521,546.21 0.69

8 120220 12 国开 20 2,600,000.00 260,192,542.27 0.63

9 120406 12 农发 06 1,400,000.00 140,052,502.12 0.34

10 160211 16 国开 11 1,300,000.00 129,965,554.15 0.31

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 次

报告期内偏离度的最高值 0.0024%

报告期内偏离度的最低值 -0.0143%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.0050%

注：上表中“偏离情况”根据报告期内各工作日数据计算。

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超过 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未超过 0.5%。

8 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

9 投资组合报告附注

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。

9.2 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.9.3 其他各项资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 55,682.48

2 应收证券清算款 -

3 应收利息 142,888,688.75

4 应收申购款 10,000.00

5 其他应收款 -

6 待摊费用 -

7 其他 -

8 合计 142,954,371.23

9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

第十二部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

自基金合同生效开始，基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率① 份额净值增长率标准差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

2016.10.12-2016.12.31 0.6127% 0.0010% 0.0788% 0.0000% 0.5339% 0.0010%

2017.1.1-2017.3.31 0.9678% 0.0015% 0.0875% 0.0000% 0.8803% 0.0015%

2016.10.12-2017.3.31 1.5865% 0.0020% 0.1663% 0.0000% 1.4202% 0.0020%

第十三部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、账户开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式在月初三个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

3、基金销售服务费

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.03% 年费率计提。

销售服务的计算方法如下：

$$H = E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式在月初三个工作日内从基金财产中一次性支付至登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第4—10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金管理费、基金托管费等费用的调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

基金管理人必须于新的费率实施日前在指定媒介上公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于2016年9月23日刊登的本基金原招募说明书（博时合鑫货币市场基金基金招募说明书）进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要补充和更新的内容如下：

- 1、在“三、基金管理人”中，对基金管理人的基本情况进行了更新；
- 2、在“四、基金托管人”中，对基金托管人的基本情况进行了更新；
- 3、在“五、相关服务机构”，更新了代销机构的信息。
- 4、在“六、基金的募集与基金合同的生效”中，更新了基金的募集和生效时间有关信息；
- 5、在“七、基金份额的申购与赎回”中，更新了基金的开放转换和定投计划有关信息；
- 6、在“八、基金的投资”中，更新了“（九）基金投资组合报告”的内容，数据内容截止时间为2017年3月31日；
- 7、在“九、基金的业绩”中，更新了“自基金合同生效开始，基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较”的数据及列表内容，数据内容截止时间为2017年3月31日；
- 8、新增“二十一、其它应披露的事项”中根据最新情况对相关应披露事项进行了更新。
 - (一)、 2017年03月27日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时合鑫货币市场基金2016年年度报告（摘要）》；
 - (二)、 2017年03月24日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时合鑫货币市场基金2017年“清明节”假期前暂停申购、转换转入公告》；
 - (三)、 2017年02月23日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分基金开通直销网上交易定期投资业务和对直销网上投资者交易费率优惠的公告》；
 - (四)、 2017年02月21日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时基金管理有限公司关于旗下部分基金修改托管协议的公告》；
 - (五)、 2017年01月21日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了

《博时合鑫货币市场基金 2016 年第 4 季度报告》；

(六)、 2017 年 01 月 18 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时合鑫货币市场基金 2017 年“春节”假期前暂停申购、转换转入公告》；

(七)、 2016 年 12 月 16 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加北京汇成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》；

(八)、 2016 年 10 月 26 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时合鑫货币市场基金开放日常申购、赎回业务的公告》；

(九)、 2016 年 10 月 26 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时合鑫货币市场基金开放日常转换、定期定额投资业务的公告》；

(十)、 2016 年 10 月 26 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时合鑫货币市场基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告》；

(十一)、 2016 年 10 月 13 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时合鑫货币市场基金基金合同生效公告》；

博时基金管理有限公司

2017 年 5 月 27 日