博时现金宝货币市场基金
2020 年中期报告
2020 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：二〇二〇年八月三十一日

§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。本中期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 2020 年 8 月 27 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 2020 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 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
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 9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
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 11
§5 托管人报告 11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 11
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 11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 11
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 14
6.4 报表附注 15
§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前十名资产支持证券投资明细 32
7.9 投资组合报告附注 32
§8 基金份额持有人信息 33
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 33
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 33
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 34
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 34
§9 开放式基金份额变动 34
§10 重大事件揭示 34
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 35
10.4 基金投资策略的改变 35
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 35
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 35
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 35
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 36
10.9 其他重大事件 36
§11 影响投资者决策的其他重要信息 37
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 37
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 37
§12 备查文件目录 37
12.1 备查文件目录 37
12.2 存放地点 37
12.3 查阅方式 37

§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	35,643,517,311.97 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	7,639,920,809.32 份	25,232,785,740.90 份	2,770,810,761.75 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		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21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益田路5999号基金大厦21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		江向阳	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	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（2020 年 1 月 1 日至 2020 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	96,868,378.23	250,007,369.35	37,745,168.72
本期利润	96,868,378.23	250,007,369.35	37,745,168.72
本期净值收益率	1.0635%	1.1844%	1.0634%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2020 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	7,639,920,809.32	25,232,785,740.90	2,770,810,761.75
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(2020 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	20.8069%	20.4435%	14.0430%

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. 根据基金管理人 2016 年 5 月 28 日发布的《博时基金管理有限公司关于博时现金宝货币市场基金增加 C 类份额以及相应修改基金合同和托管协议的公告》，博时现金宝货币市场基金自 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，具体内容请查阅指定报刊上的各项相关公告。

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	0.1395%	0.0004%	0.0292%	0.0000%	0.1103%	0.0004%
过去三个月	0.4489%	0.0005%	0.0885%	0.0000%	0.3604%	0.0005%

过去六个月	1.0635%	0.0010%	0.1769%	0.0000%	0.8866%	0.0010%
过去一年	2.3370%	0.0009%	0.3558%	0.0000%	1.9812%	0.0009%
过去三年	10.0908%	0.0023%	1.0656%	0.0000%	9.0252%	0.0023%
自基金合同生效起至今	20.8069%	0.0039%	2.0543%	0.0000%	18.7526%	0.0039%

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	0.1592%	0.0004%	0.0292%	0.0000%	0.1300%	0.0004%
过去三个月	0.5089%	0.0005%	0.0885%	0.0000%	0.4204%	0.0005%
过去六个月	1.1844%	0.0010%	0.1769%	0.0000%	1.0075%	0.0010%
过去一年	2.5408%	0.0009%	0.3558%	0.0000%	2.1850%	0.0009%
过去三年	10.5678%	0.0022%	1.0656%	0.0000%	9.5022%	0.0022%
自基金合同生效起至今	20.4435%	0.0038%	1.9892%	0.0000%	18.4543%	0.0038%

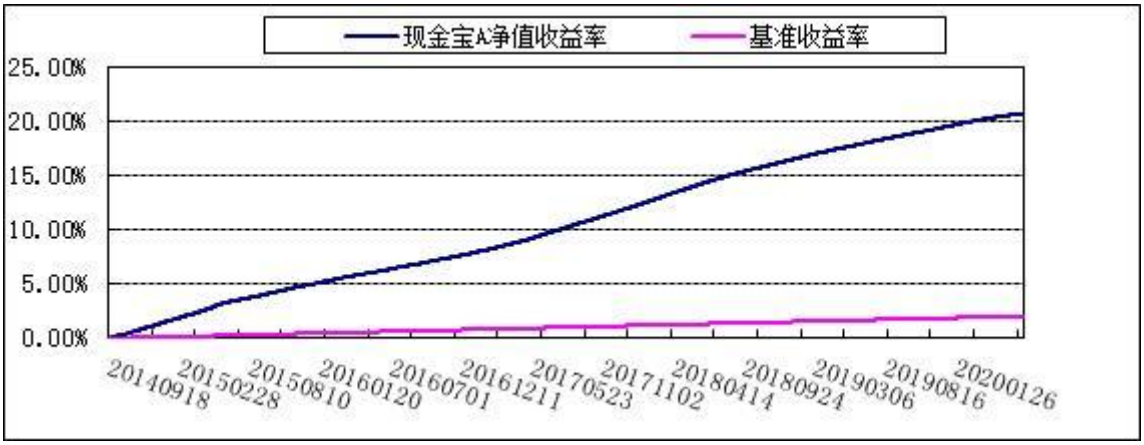
3．博时现金宝货币 C：

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	0.1395%	0.0004%	0.0292%	0.0000%	0.1103%	0.0004%
过去三个月	0.4488%	0.0005%	0.0885%	0.0000%	0.3603%	0.0005%
过去六个月	1.0634%	0.0010%	0.1769%	0.0000%	0.8865%	0.0010%
过去一年	2.3368%	0.0009%	0.3558%	0.0000%	1.9810%	0.0009%
过去三年	10.1840%	0.0024%	1.0646%	0.0000%	9.1194%	0.0024%
自基金合同生效起至今	14.0430%	0.0025%	1.4486%	0.0000%	12.5944%	0.0025%

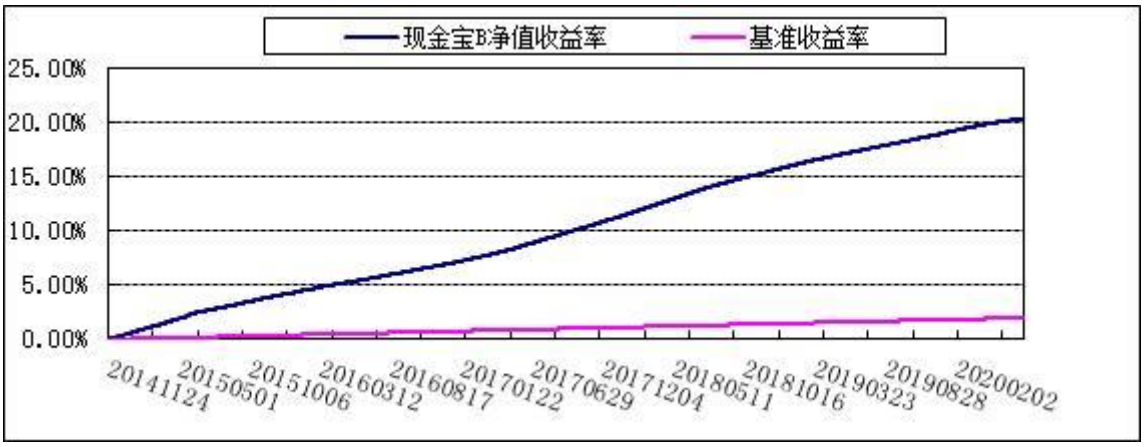
注：本基金的业绩比较基准为活期存款利率(税后)。

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

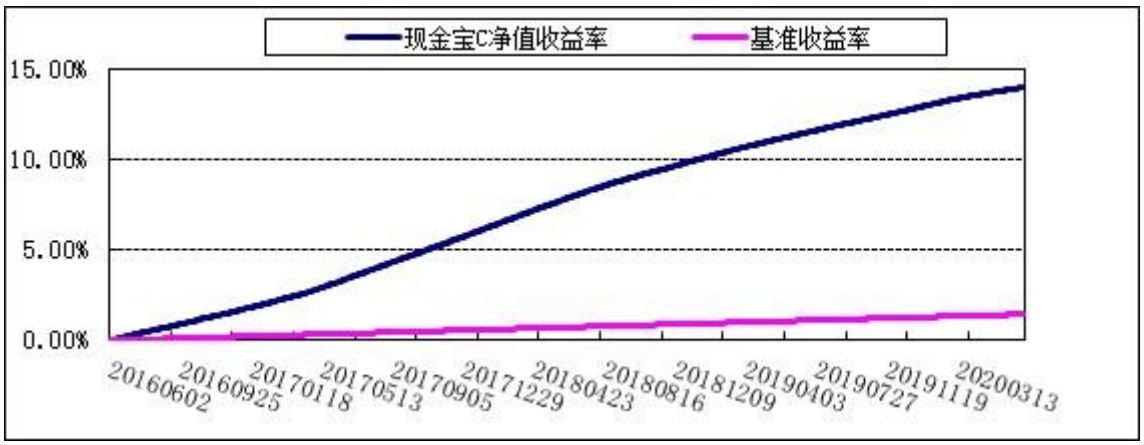
博时现金宝货币 A



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 2020 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 224 只公募基金，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、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 12150 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 3882 亿元人民币，累计分红逾 1296 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。

2020 年 6 月 29 日，《证券时报》第十五届中国基金业明星基金奖榜单公布，博时基金共荣获三项大奖，旗下产品博时外延增长主题混合与博时宏观回报债券分别拿下“三年持续回报平衡混合型明星基金”与“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。博时信用债券基金摘得“十年持续回报债券型明星基金”奖。

2020 年 4 月 1 日，博时基金及子公司博时国际荣获《亚洲资产管理》2020“Best of the Best Awards”

三项大奖。博时基金董事长兼总经理江向阳荣获“中国年度最佳 CEO”（Winner, China CEO of the Year-Jiang Xiangyang），博时基金（国际）有限公司荣获“香港最佳中资基金公司”（Winner, Hong Kong Best China Fund House），博时信用债基金荣获“中国在岸人民币债券最佳业绩（5 年）”（Winner, CNY Bonds, Onshore 5 Years-Bosera Credit Bond Fund）。

2020 年 3 月 31 日，《中国证券报》第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，博时基金旗下绩优产品博时信用债纯债债券荣获“七年期开放式债券型持续优胜金牛基金奖”。

2020 年 3 月 26 日，Morningstar 晨星（中国）2020 年度基金评选结果揭晓，博时信用债券在参选的同类 428 只基金中脱颖而出，摘得晨星“2020 年度激进债券型基金奖”。

2020 年 1 月 10 日，新京报“开放 普惠 科技”2019 金融行业评选颁奖典礼在北京举办，博时基金凭借在可持续发展金融方面的努力成果，荣获“2019 年度杰出社会责任影响力企业”。

2020 年 1 月 4 日，2020《财经》可持续发展高峰论坛暨长青奖典礼在北京举办，博时基金凭借在 ESG 投资及可持续发展金融推动方面的耕耘和成果，荣获“2020《财经》长青奖-可持续发展创新奖”。

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		
倪玉娟	基金经理	2019-02-25	-	8.9	倪玉娟女士，博士。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、博时悦楚纯债债券型证券投资基金(2018 年 4 月 9 日-2019 年 6 月 4 日)基金经理。现任博时富瑞纯债债券型证券投资基金(2018 年 4 月 9 日—至今)、博时富业纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 7 月 16 日—至今)、博时现金宝货币市场基金(2019 年 2 月 25 日—至今)、博时富丰纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2019 年 6 月 26 日—至今)、博时稳欣 39 个月定期开放债券型证券投资基金(2019 年 11 月 19 日—至今)、博时季季乐三个月持有期债券型证券投资基金(2020 年 5 月 27 日—至今)的基金经理。
李更	基金经理	2020-04-13	-	4.6	2014 年至 2015 年在华泰资

	助理				产管理有限公司工作。2015 年 11 月加入博时基金管理有限公司，任交易部交易员。现任固定收益总部基金经理助理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 93 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2020 年上半年，春节期间肺炎疫情突发打乱了全社会经济活动节奏，生产和消费的暂停快速拖累经济增长，一季度 GDP 负增长 6.8%创改革开放以来的最低值。为对冲经济下行压力，宽货币和宽信用相关刺激政策迅速执行。随着生产和消费的逐步常态化，二季度宏观经济触底回升，当季 GDP 增速 3.2%。基建和房地产为经济增长的主要推动力，消费活动恢复较疲弱，6 月份社会消费品零售总额增速-1.8%仍未转正。

货币政策重心在“稳增长”和“防风险”之间切换。2 月至 4 月侧重于“稳增长”，多次降低 OMO、MLF 利率和降准释放流动性，实现量和价同时宽松。货币市场利率降至历史最低位区间，隔夜回购利率一度保持在 0.8%以下，以同业存单为代表的货币市场工具利率也创下历史新低。二季度经济增长复苏好于预期，金融市场杠杆率重新抬头，货币政策重新转向“防风险”，流动性状态从充裕转向

平衡，资金利率和货币市场利率快速上行。7 天回购利率中枢水平抬升至 2%附近，同业存单利率较季度内最低点上行 80-90bp。

4 月份开始我们认为 3M 至 1Y 期限存款和同业存单利率与回购利率的利差处于历史最低区间，配置价值较低，可通过承受短期的机会成本换取后续收益率大幅上行后更高的再投资收益率，因此组合加大短期逆回购资产配置力度，减少 6M 及以上期限存款、存单资产配置。从结果来看该策略较为成功，有效提升组合静态收益率的同时较好地控制了组合偏离度风险。

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 1.0635%，本基金 B 类基金份额净值收益率为 1.1844%，本基金 C 类基金份额净值收益率为 1.0634%，同期业绩基准收益率 0.1769%。

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，尽管经济复苏的斜率存在争议但复苏趋势很难发生扭转，因此货币政策暂时不会从“防风险”再度切换至“稳增长”，流动性将延续当前的平衡状态，资金利率中枢或将保持在 7 天 OMO 政策利率附近。货币政策基调后续是否进一步偏紧，取决于经济复苏力度能否超预期和金融市场杠杆风险能否恶化，目前看概率并不高。

基于我们对货币政策和货币市场利率走势的预判，本基金将继续执行稳健投资策略，维持中性的平均剩余期限，降低跨年资产配置力度，控制组合偏离度风险和流动性风险暴露。日常再投资以 3M 以内逆回购资产为主，搭配年内到期的存款、存单资产，实现以机会成本有限的短期收益率换取更高的长期再投资收益率。

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债金融估值中心有限公司签署服务协议，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 96,868,378.23 元；本基金 B 类本报告期内向份额持有人分配利润 250,007,369.35 元；本基金 C 类本报告期内向份额持有人分配利润 37,745,168.72 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 托管人对本中期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 2020 年中期报告中财务指标、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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	14,331,277,211.17	11,820,074,844.43
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	14,660,214,779.67	11,233,637,493.90
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		14,602,899,779.67	11,134,637,493.90
资产支持证券投资		57,315,000.00	99,000,000.00
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	7,722,328,869.01	6,287,739,221.61
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	114,246,740.30	72,512,166.05
应收股利		-	-
应收申购款		137,294,469.37	54,492,787.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		36,965,362,069.52	29,468,456,513.75
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020 年 6 月 30 日**	**上年度末 2019 年 12 月 31 日**
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债	6.4.3.3	-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		1,306,088,946.95	1,423,159,725.31
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,380,097.92	6,580,886.42
应付托管费		1,551,870.00	1,218,682.66
应付销售服务费		2,440,015.19	3,166,485.31
应付交易费用	6.4.3.7	260,209.92	197,908.20
应交税费		5,255.04	51,696.77
应付利息		79,616.61	348,915.71
应付利润		2,055,182.70	2,073,118.69
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.3.8	983,563.22	969,300.00
负债合计		1,321,844,757.55	1,437,766,719.07
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	35,643,517,311.97	28,030,689,794.68
未分配利润	6.4.3.10	-	-
所有者权益合计		35,643,517,311.97	28,030,689,794.68
负债和所有者权益总计		36,965,362,069.52	29,468,456,513.75

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 35,643,517,311.97 份。其中 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 7,639,920,809.32 份；B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 25,232,785,740.90 份；C 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,770,810,761.75 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		**463,704,325.86**	**750,288,230.88**
1.利息收入		474,023,880.42	750,614,657.38
其中：存款利息收入	6.4.3.11	211,291,428.87	435,030,309.18
债券利息收入		175,531,378.16	269,795,775.79
资产支持证券利息收入		1,325,810.58	4,225,638.09
买入返售金融资产收入		85,875,262.81	41,562,934.32
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-10,319,554.56	-326,426.53
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	-10,319,554.56	-326,426.53
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.2	-	-
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	-	0.03
减：二、费用		**79,083,409.56**	**129,624,782.23**
1．管理人报酬		46,159,226.42	57,888,076.56
2．托管费		8,548,004.83	10,720,014.19
3．销售服务费		16,708,986.54	43,071,194.91
4．交易费用	6.4.3.18	-	-
5．利息支出		7,447,626.12	17,731,403.97
其中：卖出回购金融资产支出		7,447,626.12	17,731,403.97
6．税金及附加		4,772.91	19,098.20
7．其他费用	6.4.3.19	214,792.74	194,994.40

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**384,620,916.30**	**620,663,448.65**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**384,620,916.30**	**620,663,448.65**

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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	28,030,689,794.68	-	28,030,689,794.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	384,620,916.30	384,620,916.30
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）	7,612,827,517.29	-	7,612,827,517.29
其中：1.基金申购款	45,361,295,589.56	-	45,361,295,589.56
2.基金赎回款	-37,748,468,072.27	-	-37,748,468,072.27
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）	-	-384,620,916.30	-384,620,916.30
五、期末所有者权益（基金净值）	35,643,517,311.97	-	35,643,517,311.97
项目	**上年度可比期间** 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	45,549,131,175.06	-	45,549,131,175.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	620,663,448.65	620,663,448.65
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）	-16,162,101,375.29	-	-16,162,101,375.29
其中：1.基金申购款	51,606,383,126.26	-	51,606,383,126.26
2.基金赎回款	-67,768,484,501.55	-	-67,768,484,501.55
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）	-	-620,663,448.65	-620,663,448.65
五、期末所有者权益（基金净值）	29,387,029,799.77	-	29,387,029,799.77

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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、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》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) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	11,277,211.17
定期存款	14,320,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	4,000,000,000.00
存款期限 1-3 个月	5,920,000,000.00

存款期限 3 个月以上	4,400,000,000.00
其他存款	-
合计	14,331,277,211.17

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 2020 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	14,602,899,779.67	14,600,200,185.12	-2,699,594.55	-0.0076
	合计	14,602,899,779.67	14,600,200,185.12	-2,699,594.55	-0.0076
资产支持证券		57,315,000.00	57,022,814.88	-292,185.12	-0.0008
合计		14,660,214,779.67	14,657,223,000.00	-2,991,779.67	-0.0084

注：偏离金额＝影子定价-摊余成本；

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 2020 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	7,722,328,869.01	-
合计	7,722,328,869.01	-

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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,119.14
应收定期存款利息	87,457,268.45
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	20,878,628.96
应收资产支持证券利息	325,253.57
应收买入返售证券利息	5,584,470.18
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

应收出借证券利息	-
其他	-
合计	114,246,740.30

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 2020 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	260,209.92
合计	260,209.92

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
其他应付款	720,000.00
预提费用	263,563.22
合计	983,563.22

注：其他应付款为管理人维持偏离度而转入本基金的暂收款项。

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 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,869,095,270.02	9,869,095,270.02
本期申购	11,968,360,503.09	11,968,360,503.09
本期赎回（以“-”号填列）	-14,197,534,963.79	-14,197,534,963.79
本期末	7,639,920,809.32	7,639,920,809.32

博时现金宝货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,280,980,272.97	14,280,980,272.97
本期申购	27,219,953,005.43	27,219,953,005.43
本期赎回（以“-”号填列）	-16,268,147,537.50	-16,268,147,537.50
本期末	25,232,785,740.90	25,232,785,740.90

博时现金宝货币 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,880,614,251.69	3,880,614,251.69
本期申购	6,172,982,081.04	6,172,982,081.04
本期赎回（以“-”号填列）	-7,282,785,570.98	-7,282,785,570.98
本期末	2,770,810,761.75	2,770,810,761.75

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
上年度末	-	-	-
本期利润	96,868,378.23	-	96,868,378.23
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	-96,868,378.23	-	-96,868,378.23
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
上年度末	-	-	-
本期利润	250,007,369.35	-	250,007,369.35
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	-250,007,369.35	-	-250,007,369.35
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
上年度末	-	-	-
本期利润	37,745,168.72	-	37,745,168.72
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	-37,745,168.72	-	-37,745,168.72
本期末	-	-	-

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	30,756.55

定期存款利息收入	211,144,732.25
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	115,940.07
合计	211,291,428.87

6.4.3.12 股票投资收益

无发生额。

6.4.3.13.1 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	23,734,064,046.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	23,659,069,497.16
减：应收利息总额	85,314,104.00
买卖债券差价收入	-10,319,554.56

6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	92,584,255.50
减：卖出资产支持证券成本总额	91,685,000.00
减：应收利息总额	899,255.50
资产支持证券投资收益	-

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

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 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	74,590.88
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-

银行汇划费	61,929.52
中债登账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,600.00
合计	214,792.74

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

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

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
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	46,159,226.42	57,888,076.56
其中：支付销售机构的客户维护费	5,028,237.05	6,708,824.76

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 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托	8,548,004.83	10,720,014.19

管费		

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	5,603,289.64	950,687.00	4,152,683.53	10,706,660.17
招商证券	-	2.34	209,132.54	209,134.88
合计	5,603,289.64	950,689.34	4,361,816.07	10,915,795.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	11,765,110.20	10,372,057.82	11,015,712.92	33,152,880.94
招商证券	-	-	610,399.98	610,399.98
合计	11,765,110.20	10,372,057.82	11,626,112.90	33,763,280.92

注：1.支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类基金份额、B 类基金份额和 C 类基金份额基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额、B 类基金份额和 C 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%、0.25%和 0.25%。其计算公式为：日销售服务费＝前一日 A/B/C 类基金资产净值×约定年费率/当年天数。

2.根据《博时基金管理有限公司关于博时现金宝货币市场基金 B 类基金份额销售服务费率优惠的公告》，自 2018 年 2 月 6 日至 2018 年 3 月 6 日、2018 年 3 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日，和 2018 年 5 月 15 日起至 2019 年 1 月 27 日止，本基金 B 类基金份额的销售服务费按原费率打折，折后本基金 B 类基金份额的年销售服务费率为 0.05%。其计算公式为：日销售服务费＝前一日 B 类基金资产净值×0.05%/当年天数。

自 2019 年 1 月 28 日至 2019 年 10 月 17 日止，本基金 B 类基金份额的销售服务费按原费率打折，折后本基金 B 类基金份额的年销售服务费率为 0.15%。其计算公式为：日销售服务费＝前一日 B 类基金资产净值×0.15%/当年天数。

自 2019 年 10 月 18 日至管理人另行公告日止，本基金 B 类基金份额的销售服务费按原费率打折，折后本基金 B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%。其计算公式为：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 2020年1月1日至2020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
中国工商银行	-	-	-	-	11,835,631,000.00	445,384.48
上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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

中国工商银行	-	-	-	-	5,538,940,000.00	824,625.99

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 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

无。

博时现金宝货币 B

份额单位：份

关联方名称	博时现金宝货币B本期末 2020年6月30日		博时现金宝货币B上年度末 2019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
博时资本管理有限公司	79,118,865.56	0.22%	-	-

博时现金宝货币 C

无。

6.4.6.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	11,277,211.17	30,756.55	6,796,577.78	79,435.20

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

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
97,160,355.94	-	-291,977.71	96,868,378.23	-

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
249,606,099.16	-	401,270.19	250,007,369.35	-

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
37,872,397.19	-	-127,228.47	37,745,168.72	-

6.4.8 期末（2020 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 2020 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 1,306,088,946.95 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
209922	20 贴现国债 22	2020-07-01	99.86	4,800,000.00	479,328,000.00
130422	13 农发 22	2020-07-01	100.58	49,000.00	4,928,420.00
150420	15 农发 20	2020-07-01	100.37	2,200,000.00	220,814,000.00
209918	20 贴现国债 18	2020-07-01	99.95	2,000,000.00	199,900,000.00
209917	20 贴现国债 17	2020-07-01	99.97	2,100,000.00	209,937,000.00
170209	17 国开 09	2020-07-01	100.43	622,000.00	62,467,460.00
209920	20 贴现国债 20	2020-07-01	99.90	1,500,000.00	149,850,000.00
合计				13,271,000.00	1,327,224,880.00

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人中国工商银行；定期存款存放在具有基金托管资格的银行和其他主体信用评级为 AAA 的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。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资产的 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 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
A-1	560,002,534.65	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,259,267,833.10	904,147,188.59
合计	1,819,270,367.75	904,147,188.59

注：未评级债券为国债、政策性金融债和短期融资券。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

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	上年末

	2020年6月30日	2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	12,201,076,989.59	9,631,873,846.29
合计	12,201,076,989.59	9,631,873,846.29

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 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	582,552,422.33	598,616,459.02
合计	582,552,422.33	598,616,459.02

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 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
AAA	57,315,000.00	99,000,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	57,315,000.00	99,000,000.00

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

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 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 1,306,088,946.95 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。

6.4.9.3.1 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 2020 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 30.34%，本基金投资组合的平均剩余期限为 70 天，平均剩余存续期为 70 天。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。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净资产的 10%。

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。

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 2020 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	14,331,277,211.17	-	-	-	14,331,277,211.17
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	13,971,072,256.92	689,142,522.75	-	-	14,660,214,779.67
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	7,722,328,869.01	-	-	-	7,722,328,869.01
应收利息	-	-	-	114,246,740.30	114,246,740.30
应收申购款	-	-	-	137,294,469.37	137,294,469.37
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	**36,024,678,337.10**	**689,142,522.75**	**-**	**251,541,209.67**	**36,965,362,069.52**
负债					
卖出回购金融资产款	1,306,088,946.95	-	-	-	1,306,088,946.95
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	8,380,097.92	8,380,097.92
应付托管费	-	-	-	1,551,870.00	1,551,870.00
应付销售服务费	-	-	-	2,440,015.19	2,440,015.19
应交税费	-	-	-	5,255.04	5,255.04
应付交易费用	-	-	-	260,209.92	260,209.92
应付利息	-	-	-	79,616.61	79,616.61
应付利润	-	-	-	2,055,182.70	2,055,182.70
其他负债	-	-	-	983,563.22	983,563.22
负债总计	**1,306,088,946.95**	**-**	**-**	**15,755,810.60**	**1,321,844,757.55**
利率敏感度缺口	**34,718,589,390.15**	**689,142,522.75**	**-**	**235,785,399.07**	**35,643,517,311.97**
上年度末 2019 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	8,120,074,844.43	3,700,000,000.00	-	-	11,820,074,844.43
交易性金融资产	10,655,933,668.29	577,703,825.61	-	-	11,233,637,493.90
买入返售金融资产	6,287,739,221.61	-	-	-	6,287,739,221.61
应收利息	-	-	-	72,512,166.05	72,512,166.05
应收申购款	-	-	-	54,492,787.76	54,492,787.76
资产总计	**25,063,747,734.33**	**4,277,703,825.61**	**-**	**127,004,953.81**	**29,468,456,513.75**
负债					

卖出返售金融资产	1,423,159,725.31	-	-	-	1,423,159,725.31
应付管理人报酬	-	-	-	6,580,886.42	6,580,886.42
应付托管费	-	-	-	1,218,682.66	1,218,682.66
应付销售服务费	-	-	-	3,166,485.31	3,166,485.31
应付交易费用	-	-	-	197,908.20	197,908.20
应交税费	-	-	-	51,696.77	51,696.77
应付利息	-	-	-	348,915.71	348,915.71
应付利润	-	-	-	2,073,118.69	2,073,118.69
其他负债	-	-	-	969,300.00	969,300.00
负债总计	**1,423,159,725.31**	**-**	**-**	**14,606,993.76**	**1,437,766,719.07**
利率敏感度缺口	**23,640,588,009.02**	**4,277,703,825.61**	**-**	**112,397,960.05**	**28,030,689,794.68**

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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	增加约 872	增加约 610
	市场利率上升 25 个基点	减少约 870	减少约 610

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 2020 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 14,660,214,779.67 元，无属于第一或第三层次的余额（2019 年 12 月 31 日：第二

层次 11,233,637,493.90 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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 2020 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（2019 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	14,660,214,779.67	39.66
	其中：债券	14,602,899,779.67	39.50
	资产支持证券	57,315,000.00	0.16
2	买入返售金融资产	7,722,328,869.01	20.89
	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	14,331,277,211.17	38.77
4	其他各项资产	251,541,209.67	0.68
5	合计	36,965,362,069.52	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	2.76	
	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	1,306,088,946.95	3.66

	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%。

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	70
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

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	32.52	3.66
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	12.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	30.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	13.35	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	13.98	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		103.00	3.66

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

报告期内投资组合未出现平均剩余期限超过 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	1,108,867,687.53	3.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	732,952,567.90	2.06
	其中：政策性金融债	732,952,567.90	2.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	560,002,534.65	1.57
6	中期票据	-	-
7	同业存单	12,201,076,989.59	34.23
8	其他	-	-
9	合计	14,602,899,779.67	40.97
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

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	112093955	20 北京农商银行 CD047	5,000,000	497,550,004.97	1.40
2	112009235	20 浦发银行 CD235	5,000,000	497,364,647.02	1.40
3	209922	20 贴现国债 22	4,800,000	479,312,124.63	1.34
4	112081347	20 北京农商银行 CD114	4,000,000	398,154,365.21	1.12
5	112080927	20 广州农村商业银行 CD057	3,500,000	348,522,741.81	0.98
6	112013022	20 浙商银行 CD022	3,500,000	348,377,644.91	0.98
7	111908161	19 中信银行 CD161	3,000,000	299,582,374.45	0.84
8	112093365	20 上海农商银行 CD020	3,000,000	298,698,951.33	0.84
9	112016072	20 上海银行 CD072	3,000,000	298,441,575.86	0.84
10	112095764	20 苏州银行 CD076	3,000,000	298,414,507.57	0.84

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

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	0.1050%
报告期内偏离度的最低值	-0.0201%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0502%

注：上表中“偏离情况”根据报告期内各交易日数据计算。

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）	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	168263	碧山 01 优	500,000.00	50,000,000.00	0.14
2	138169	平汽 3A1	500,000.00	7,315,000.00	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 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除 20 浦发银行 CD235(112009235)、20 浙商银行 CD022(112013022)、19 中信银行 CD161(111908161)、20 上海农商银行 CD020(112093365)、20 上海银行 CD072(112016072)、20 广州农村商业银行 CD057（112080927）、20 北京农商银行 CD047（112093955）、20 北京农商银行 CD114（112081347）的发行主体外，没有出现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、处罚的情形。

主要违规事实：2019 年 10 月 14 日，因公司成都分行授信业务及整改情况严重失察、 重大审计发现未向监管部门报告、 轮岗制度执行不力的违规行为，中国银行保险监督管理委员会对上海浦东发展银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020 年 1 月 10 日，因存在未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料及交易记录、未按规定进行可疑交易报告等违规行为，中国人民银行杭州市中心支行对浙商银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2019 年 8 月 9 日，因存在未按规定提供报表且逾期未改正等违规行为，中国银行保险监督管理委员会对中信银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2019 年 7 月 9 日，上海农村商业银行股份有限公司因存在为某申请人办理信用卡业务时，对申请人收入核定严重不审慎的违规行为，中国银行业监督管理委员会上海监管局对其处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2019 年 11 月 14 日，因存在违反支付业务规定的违规行为，中国人民银行上海总部对上海银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2019 年 10 月 31 日，因存在违规向客户收取服务费的违规行为，中国银保监会广东监管局对广州农村商业银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020 年 3 月 2 日，因存在违规审批发放贷款、贷款资金被挪用、违规开展票据业务等违规行为，中国银行保险监督管理委员会北京监管局对北京农村商业银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

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	114,246,740.30
4	应收申购款	137,294,469.37
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	251,541,209.67

7.9.4 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。

§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	1,518,041	5,032.75	143,675,616.41	1.88%	7,496,245,192.91	98.12%
博时现金宝货币 B	224,552	112,369.45	23,217,411,422.74	92.01%	2,015,374,318.16	7.99%
博时现金宝货币 C	363,537	7,621.81	3,755,846.95	0.14%	2,767,054,914.80	99.86%
合计	2,106,130	16,923.70	23,364,842,886.10	65.55%	12,278,674,425.87	34.45%

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	2,012,516,418.62	5.65%
2	银行类机构	1,028,251,042.07	2.88%
3	银行类机构	1,022,572,140.95	2.87%
4	银行类机构	1,017,049,228.18	2.85%
5	银行类机构	1,012,170,917.03	2.84%
6	其他机构	1,006,258,209.36	2.82%
7	银行类机构	1,005,967,738.04	2.82%
8	银行类机构	1,002,175,148.06	2.81%

9	银行类机构	906,660,804.38	2.54%
10	银行类机构	799,154,006.93	2.24%

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）	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	17,213,862.61	0.23%
	博时现金宝货币 B	566,006.81	0.00%
	博时现金宝货币 C	404.15	0.00%
	合计	17,780,273.57	0.05%

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	0~10
	博时现金宝货币 C	0
	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	0~10
	博时现金宝货币 B	0~10
	博时现金宝货币 C	0
	合计	0~10

§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
基金合同生效日（2014 年 9 月 18 日）基金份额总额	212,804,225.09	-	-
本报告期期初基金份额总额	9,869,095,270.02	14,280,980,272.97	3,880,614,251.69
本报告期基金总申购份额	11,968,360,503.09	27,219,953,005.43	6,172,982,081.04
减：本报告期基金总赎回份额	14,197,534,963.79	16,268,147,537.50	7,282,785,570.98
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,639,920,809.32	25,232,785,740.90	2,770,810,761.75

§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

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：1、基金管理人于 2020 年 1 月 10 日发布了《博时

基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张光华先生不再担任公司董事长职务，由公司总经理江向阳先生代为履行董事长职务。2、基金管理人于 2020 年 4 月 17 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，江向阳先生任博时基金管理有限公司董事长。

本报告期内，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 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	-	-	-	-	-	-
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	博时基金管理有限公司关于暂停使用中国银行理财直付服务办理直销网上交易部分业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
2	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
3	关于博时旗下部分基金参加招商银行申购及定投业务费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-01
4	博时现金宝货币市场基金 2020 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-04-22
5	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-04-17
6	博时现金宝货币市场基金 2019 年年度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-03-27
7	博时基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间暂停办理申购赎回等业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-28
8	博时现金宝货币市场基金 2019 年第 4 季度报	证券时报、基金管理人网	2020-01-17

	告定稿	站、证监会基金电子披露网	

§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

二〇二〇年八月三十一日