

博时合利货币市场基金  
2025 年中期报告  
2025 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月二十九日

## § 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 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                               | 5  |
| 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合规守信情况的说明               | 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              | 10 |
| 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        | 12 |
| § 5 托管人报告                                | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                   | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明  | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见        | 12 |
| § 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 净资产变动表                               | 14 |
| 6.4 报表附注                                 | 16 |
| § 7 投资组合报告                               | 33 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                           | 33 |
| 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                         | 34 |
| 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                     | 35 |
| 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 | 35 |
| 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离       | 35 |
| 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    | 36 |
| 7.9 投资组合报告附注                             | 36 |
| § 8 基金份额持有人信息                            | 37 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                    | 37 |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况                   | 37 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                 | 37 |
| 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        | 37 |
| § 9 开放式基金份额变动                            | 38 |
| § 10 重大事件揭示                              | 38 |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 38        |
| 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 .....   | 38        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 38        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 38        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 38        |
| 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 .....      | 39        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 39        |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....              | 39        |
| 10.9 其他重大事件 .....                        | 40        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>40</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 ..... | 41        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 41        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>41</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 41        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 41        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 41        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称            | 博时合利货币市场基金         |                    |
| 基金简称            | 博时合利货币             |                    |
| 基金主代码           | 002960             |                    |
| 交易代码            | 002960             |                    |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                    |
| 基金合同生效日         | 2016 年 8 月 3 日     |                    |
| 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         |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 5,753,490,000.39 份 |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 博时合利货币 A           | 博时合利货币 B           |
| 下属分级基金的交易代码     | 008191             | 002960             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 143,852,946.64 份   | 5,609,637,053.75 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。主要投资策略有：利率策略、骑乘策略、放大策略、信用债投资策略、资产支持证券投资策略。 |
| 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均低于股票型基金、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                    | 招商银行股份有限公司                  |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 吴曼                            | 张姗                          |
|         | 联系电话 | 0755-83169999                 | 400-61-95555                |
|         | 电子邮箱 | service@bosera.com            | zhangshan_1027@cmbchina.com |
| 客户服务电话  |      | 95105568                      | 400-61-95555                |
| 传真      |      | 0755-83195140                 | 0755-83195201               |
| 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 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦          |
| 办公地址    |      | 广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层      | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦          |
| 邮政编码    |      | 518040                        | 518040                      |

|       |     |     |
|-------|-----|-----|
| 法定代表人 | 江向阳 | 缪建民 |
|-------|-----|-----|

## 2.4 信息披露方式

|                     |                       |
|---------------------|-----------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 上海证券报                 |
| 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 | 北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301 |

## § 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<br>数据和指标 | 报告期（2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日） |                  |
|-------------------|-------------------------------------|------------------|
|                   | 博时合利货币 A                            | 博时合利货币 B         |
| 本期已实现收益           | 952,503.59                          | 49,373,644.99    |
| 本期利润              | 952,503.59                          | 49,373,644.99    |
| 本期净值收益率           | 0.6429%                             | 0.7530%          |
| 3.1.2 期末<br>数据和指标 | 报告期末（2025 年 6 月 30 日）               |                  |
|                   | 博时合利货币 A                            | 博时合利货币 B         |
| 期末基金资产净值          | 143,852,946.64                      | 5,609,637,053.75 |
| 期末基金份额净值          | 1.0000                              | 1.0000           |
| 3.1.3 累计<br>期末指标  | 报告期末（2025 年 6 月 30 日）               |                  |
|                   | 博时合利货币 A                            | 博时合利货币 B         |
| 累计净值收益率           | 10.3883%                            | 24.3307%         |

注：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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

### 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. 博时合利货币 A:

| 阶段 | 份额净值收<br>益率① | 净值收益率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|--------------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|
|----|--------------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|

|            |          |         |         |         |         |         |
|------------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 过去一个月      | 0.1027%  | 0.0010% | 0.0292% | 0.0000% | 0.0735% | 0.0010% |
| 过去三个月      | 0.3119%  | 0.0008% | 0.0885% | 0.0000% | 0.2234% | 0.0008% |
| 过去六个月      | 0.6429%  | 0.0008% | 0.1760% | 0.0000% | 0.4669% | 0.0008% |
| 过去一年       | 1.3778%  | 0.0010% | 0.3549% | 0.0000% | 1.0229% | 0.0010% |
| 过去三年       | 5.0071%  | 0.0013% | 1.0656% | 0.0000% | 3.9415% | 0.0013% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.3883% | 0.0012% | 1.9794% | 0.0000% | 8.4089% | 0.0012% |

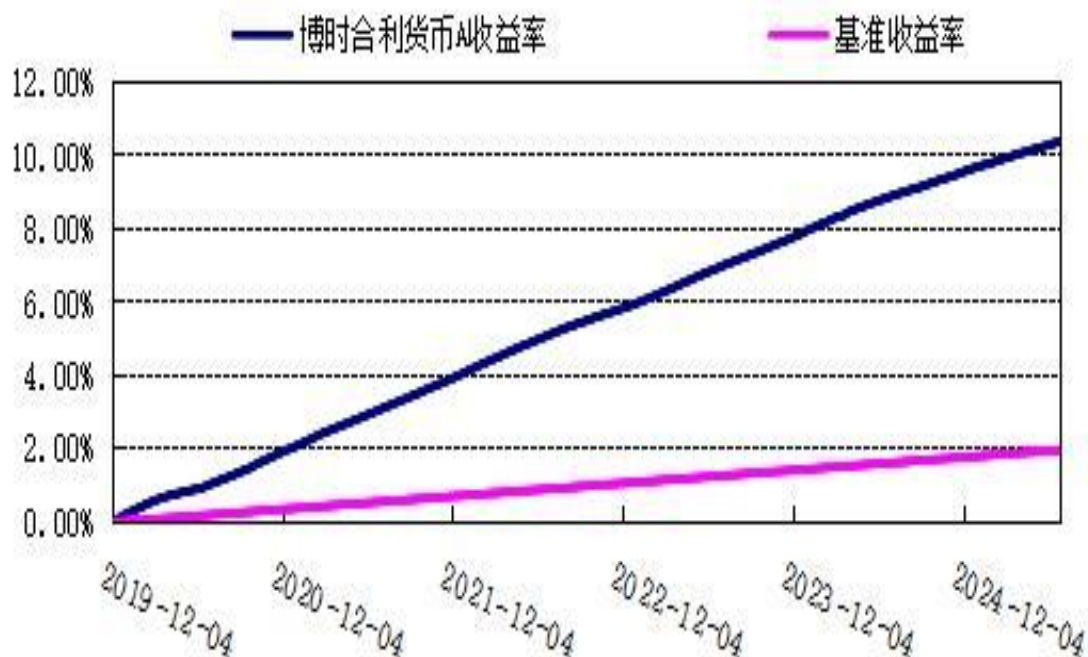
## 2. 博时合利货币 B:

| 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      | 0.1208%  | 0.0010%   | 0.0292%    | 0.0000%       | 0.0916%  | 0.0010% |
| 过去三个月      | 0.3671%  | 0.0008%   | 0.0885%    | 0.0000%       | 0.2786%  | 0.0008% |
| 过去六个月      | 0.7530%  | 0.0008%   | 0.1760%    | 0.0000%       | 0.5770%  | 0.0008% |
| 过去一年       | 1.6007%  | 0.0010%   | 0.3549%    | 0.0000%       | 1.2458%  | 0.0010% |
| 过去三年       | 5.7011%  | 0.0013%   | 1.0656%    | 0.0000%       | 4.6355%  | 0.0013% |
| 自基金合同生效起至今 | 24.3307% | 0.0026%   | 3.1636%    | 0.0000%       | 21.1671% | 0.0026% |

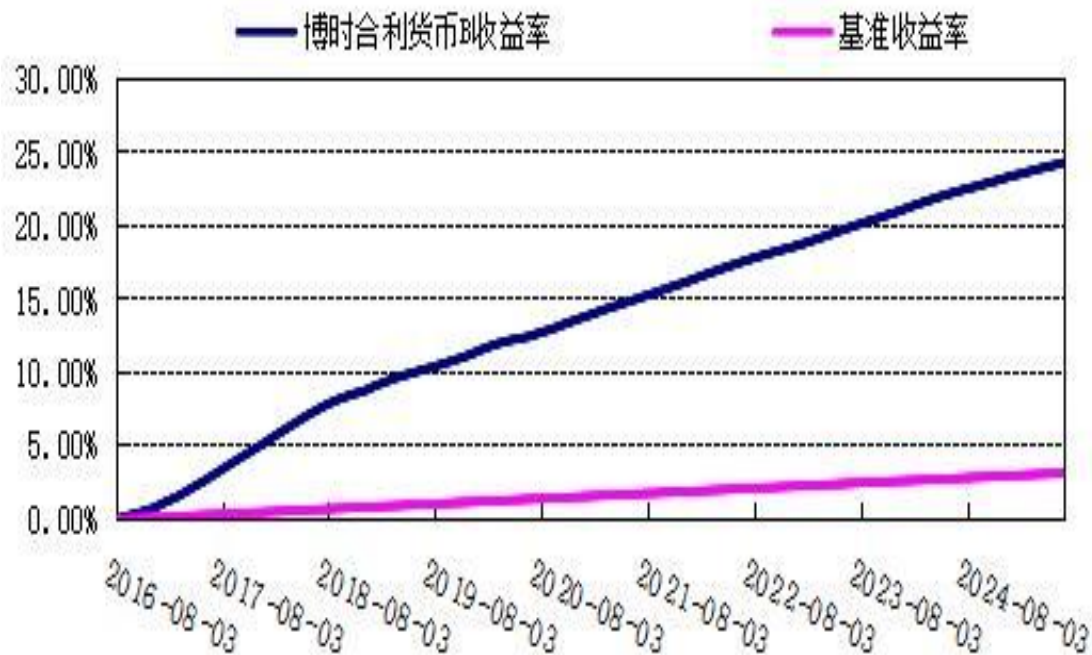
注：基金收益分配是按日结转份额；本基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

## 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

### 博时合利货币 A



### 博时合利货币 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”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2025 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 394 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 16,069 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,729 亿元人民币，累计分红逾 2,186 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

#### 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<br>（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                    |
|-----|------|---------------------|------|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |      | 任职日期                | 离任日期 |        |                                                                                                                                       |
| 鲁邦旺 | 基金经理 | 2019-02-25          | -    | 15.4   | 鲁邦旺先生，硕士。2008 年至 2016 年在平安保险集团公司工作，历任资金经理、固定收益投资经理。2016 年加入博时基金管理有限公司。历任博时裕丰纯债债券型证券投资基金（2016 年 12 月 15 日-2017 年 10 月 17 日）、博时裕和纯债债券型证 |

|  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  | 券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2017 年 10 月 19 日)、博时裕盈纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2017 年 10 月 25 日)、博时裕嘉纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2017 年 11 月 15 日)、博时裕坤纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2018 年 2 月 7 日)、博时裕晟纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2018 年 8 月 10 日)、博时安慧 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2017 年 12 月 29 日-2018 年 9 月 6 日)、博时裕达纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2019 年 3 月 11 日)、博时裕恒纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2019 年 3 月 11 日)、博时裕泰纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2019 年 3 月 11 日)、博时裕瑞纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2019 年 3 月 11 日)、博时裕荣纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2019 年 3 月 11 日)、博时裕康纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2019 年 3 月 11 日)、博时裕丰纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2017 年 10 月 18 日-2019 年 3 月 11 日)、博时裕盈纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2017 年 10 月 26 日-2019 年 3 月 11 日)、博时裕嘉纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2017 年 11 月 16 日-2019 年 3 月 11 日)、博时裕坤纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 2 月 8 日-2019 年 3 月 11 日)、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 2 日-2019 年 8 月 19 日)、博时兴盛货币市场基金(2019 年 2 月 25 日-2022 年 6 月 22 日)、博时合晶货币市场基金(2019 年 2 月 25 日-2022 年 6 月 22 日)、博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2022 年 11 月 16 日)、博时合鑫货币市场基金(2019 年 2 月 25 日-2023 年 10 月 17 日)、博时外服货币市场基金(2019 年 2 月 25 日-2023 年 10 |
|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|    |        |            |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|----|--------|------------|---|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |        |            |   |      | 月 17 日)的基金经理。现任博时天天增利货币市场基金(2017 年 4 月 26 日一至今)、博时保证金实时交易型货币市场基金(2017 年 4 月 26 日一至今)、博时兴荣货币市场基金(2018 年 3 月 19 日一至今)、博时合利货币市场基金(2019 年 2 月 25 日一至今)、博时月月享 30 天持有期短债债券型发起式证券投资基金(2021 年 5 月 12 日一至今)、博时景发纯债债券型证券投资基金(2022 年 7 月 14 日一至今)、博时岁岁增利一年持有期债券型证券投资基金(2022 年 11 月 17 日一至今)、博时月月乐同业存单 30 天持有期混合型证券投资基金(2023 年 9 月 12 日一至今)、博时双月乐 60 天持有期债券型证券投资基金(2023 年 11 月 14 日一至今)、博时合鑫货币市场基金(2024 年 7 月 5 日一至今)、博时兴盛货币市场基金(2024 年 7 月 5 日一至今)的基金经理,博时合惠货币市场基金的基金经理助理。 |
| 刘硕 | 基金经理助理 | 2023-01-16 | - | 12.8 | 刘硕女士, 硕士。2012 年至 2014 年在安信证券工作。2014 年 9 月加入博时基金管理有限公司。现任基金经理助理。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内, 本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定, 并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产, 为基金持有人谋求最大利益。本报告期内, 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 23 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

2025 年上半年经济运行整体平稳，工业生产与消费增长稳健，权益风险偏好提振。央行货币政策宽松落地，货币和财政政策协同配合，传导效率持续增强。

市场方面，年初同业活期存款利率自律管理正式纳入宏观审慎评估体系（MPA）评估考核，资金面宽松带动 1 年期国股存单下行至上半年低点 1.54%。1 月 10 日央行公告阶段性暂停在公开市场买入国债，银行同业存款溢出效应加剧银行头寸压力，1 年期国股存单上行至 3 月初 2.04% 的上半年高点。3 月 24 日央行公告本月起 MLF 将采用固定数量、利率招标、多重价位中标方式开展操作，并提前公告超量续作，跨季资金面平稳，1 年期国股存单利率下行至 1.88%。进入二季度，4 月初受中美关税政策调整影响，债券市场升温带动货币市场利率下行，1 年期国股存单下行至 1.73% 后窄幅震荡。5 月上旬央行宣布降准降息，推动 1 年期国股存单下行至 1.66%。5 月下旬资金价格小幅上行，叠加市场对 6 月同业存单到期量超 4 万亿的担忧，1 年期国股存单利率小幅反弹至 1.72%。6 月上旬央行提前公告逆回购操作，市场对银行负债压力担忧逐步缓解，存单发行供需双强，季末时点央行公开市场投放积极，跨季资金价格始终保持稳定，1 年期国股存单利率逐渐回落至 1.65%。

##### 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 0.6429%，本基金 B 基金份额净值收益率为 0.7530%，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

展望下半年，经济基本面保持稳健，流动性维持均衡状态，货币政策将延续“适度宽松”的基调，强化逆周期调节，综合运用多种货币政策工具，助力经济持续回升向好。往后需要关注：一是经济、金融数据反映经济是否企稳回升；二是政府债与存单发行节奏的影响，以及资金面带动的市场情绪走势；三是海外关税等政策动向。投资策略方面，组合将灵活调整久期和杠杆，投资品种以短期限的逆回购和同业存单为主，重视收益率低位及时止盈和流动性管理，在缴税、月末等货币市场利率波动时点加大配置力度。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券

投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。为确保基金估值工作符合以上规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人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公司领导、督察长、法律合规部负责人、风险管理部负责人、投资部门负责人、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备良好专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制订健全、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，保证基金估值的公平、合理。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金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，当对估值原则及技术存有异议时，本基金托管人有责任要求本基金管理人作出合理解释，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、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金同一类别每份基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式为红利再投资；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，本基金根据每日基金收益情况，以各类基金份额的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，且定期进行结转。本基金的收益结转方式支持按日结转或按月结转，具体采用哪种方式以销售机构公布的为准。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，则为基金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，则为基金份额持有人缩减相应的基金份额，当投资人赎回基金份额时，将按比例从赎回款中扣除，剩余部分缩减投资人的基金份额；如投资者的累计未结转收益等于零时，基金份额持有人的基金份额保持不变；当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会；如需召开基金份额持有人大会，为确保基金份额持有人的表决权体现其持有的权益，基金管理人将于召开基金份额持有人大会的权益登记日当日统一为各类份额类别的基金份额持有人进行累计未结转收益的结转；法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

本基金 A 类本报告期内向份额持有人分配利润 952,503.59 元；本基金 B 类本报告期内向份额持有人分配利润 49,373,644.99 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 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：博时合利货币市场基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 货币资金       | 6.4.6.1 | 904,661,041.12         | 707,821,662.23           |
| 结算备付金      |         | -                      | -                        |
| 存出保证金      |         | 1,098.00               | 4,512.31                 |

|               |            |                                |                                  |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 交易性金融资产       | 6.4.6.2    | 4,833,954,308.67               | 4,978,822,771.49                 |
| 其中：股票投资       |            | -                              | -                                |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | 4,833,954,308.67               | 4,978,822,771.49                 |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资         |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产        | 6.4.6.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产      | 6.4.6.4    | 805,545,871.49                 | 835,221,770.64                   |
| 其他债权投资        |            | -                              | -                                |
| 其他权益工具投资      |            | -                              | -                                |
| 应收清算款         |            | 99,908,053.85                  | -                                |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 11,769,338.47                  | 116,474,853.23                   |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.6.5    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 6,655,839,711.60               | 6,638,345,569.90                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2025 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2024 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        | 6.4.6.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | 900,330,046.25                 | 267,082,294.02                   |
| 应付清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款         |            | 502.88                         | 164,789.82                       |
| 应付管理人报酬       |            | 980,723.66                     | 1,078,391.54                     |
| 应付托管费         |            | 326,907.89                     | 359,463.86                       |
| 应付销售服务费       |            | 223,688.39                     | 248,116.76                       |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | -                              | 22,155.31                        |
| 应付利润          |            | 221,746.02                     | 276,558.75                       |
| 递延所得税负债       |            | -                              | -                                |
| 其他负债          | 6.4.6.6    | 266,096.12                     | 192,443.82                       |
| 负债合计          |            | 902,349,711.21                 | 269,424,213.88                   |
| <b>净资产：</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金          | 6.4.6.7    | 5,753,490,000.39               | 6,368,921,356.02                 |
| 其他综合收益        |            | -                              | -                                |
| 未分配利润         | 6.4.6.8    | 0.00                           | 0.00                             |
| 净资产合计         |            | 5,753,490,000.39               | 6,368,921,356.02                 |
| 负债和净资产总计      |            | 6,655,839,711.60               | 6,638,345,569.90                 |

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 5,753,490,000.39 份，其中 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 143,852,946.64 份，B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 5,609,637,053.75 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时合利货币市场基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                              | 附注号      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6<br>月 30 日 |
|---------------------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>                  |          | <b>60,748,707.57</b>                     | <b>90,264,637.66</b>                          |
| 1. 利息收入                         |          | 16,913,366.88                            | 48,843,800.63                                 |
| 其中：存款利息收入                       | 6.4.6.9  | 4,723,325.05                             | 18,374,978.80                                 |
| 债券利息收入                          |          | -                                        | -                                             |
| 资产支持证券利息收入                      |          | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入                      |          | 12,190,041.83                            | 30,468,821.83                                 |
| 其他利息收入                          |          | -                                        | -                                             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）               |          | 43,835,340.69                            | 41,420,837.03                                 |
| 其中：股票投资收益                       | 6.4.6.10 | -                                        | -                                             |
| 基金投资收益                          |          | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                          | 6.4.6.11 | 43,835,340.69                            | 41,420,837.03                                 |
| 资产支持证券投资收益                      | 6.4.6.12 | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益                         |          | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                          | 6.4.6.13 | -                                        | -                                             |
| 股利收益                            | 6.4.6.14 | -                                        | -                                             |
| 以摊余成本计量的金融资产<br>终止确认产生的收益（若有）   |          | -                                        | -                                             |
| 其他投资收益                          |          | -                                        | -                                             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”<br>号填列）      | 6.4.6.15 | -                                        | -                                             |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）              |          | -                                        | -                                             |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）              | 6.4.6.16 | -                                        | -                                             |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |          | <b>10,422,558.99</b>                     | <b>10,134,385.53</b>                          |
| 1. 管理人报酬                        |          | 5,026,658.87                             | 6,209,188.18                                  |
| 其中：暂估管理人报酬（若有）                  |          | -                                        | -                                             |
| 2. 托管费                          |          | 1,675,552.96                             | 2,069,729.47                                  |
| 3. 销售服务费                        |          | 1,167,923.79                             | 1,371,839.47                                  |
| 4. 投资顾问费                        |          | -                                        | -                                             |
| 5. 利息支出                         |          | 2,434,179.30                             | 352,421.75                                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出                   |          | 2,434,179.30                             | 352,421.75                                    |
| 6. 信用减值损失                       | 6.4.6.17 | -                                        | -                                             |
| 7. 税金及附加                        |          | 465.12                                   | 5,195.72                                      |
| 8. 其他费用                         | 6.4.6.18 | 117,778.95                               | 126,010.94                                    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号<br/>填列）</b> |          | <b>50,326,148.58</b>                     | <b>80,130,252.13</b>                          |
| 减：所得税费用                         |          | -                                        | -                                             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>        |          | <b>50,326,148.58</b>                     | <b>80,130,252.13</b>                          |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>            |          | <b>-</b>                                 | <b>-</b>                                      |
| <b>六、综合收益总额</b>                 |          | <b>50,326,148.58</b>                     | <b>80,130,252.13</b>                          |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：博时合利货币市场基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日      |            |                |                    |
|------------------------------------------|---------------------------------|------------|----------------|--------------------|
|                                          | 实收基金                            | 其他综合收益（若有） | 未分配利润          | 净资产合计              |
| 一、上期期末净资产                                | 6,368,921,356.02                | -          | -              | 6,368,921,356.02   |
| 加：会计政策变更                                 | -                               | -          | -              | -                  |
| 前期差错更正                                   | -                               | -          | -              | -                  |
| 其他                                       | -                               | -          | -              | -                  |
| 二、本期期初净资产                                | 6,368,921,356.02                | -          | -              | 6,368,921,356.02   |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -615,431,355.63                 | -          | 0.00           | -615,431,355.63    |
| （一）、综合收益总额                               | -                               | -          | 50,326,148.58  | 50,326,148.58      |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -615,431,355.63                 | -          | -              | -615,431,355.63    |
| 其中：1. 基金申购款                              | 29,369,748,744.88               | -          | -              | 29,369,748,744.88  |
| 2. 基金赎回款                                 | -29,985,180,100.51              | -          | -              | -29,985,180,100.51 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                               | -          | -50,326,148.58 | -50,326,148.58     |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -                               | -          | -              | -                  |
| 四、本期期末净资产                                | 5,753,490,000.39                | -          | -              | 5,753,490,000.39   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |            |                |                    |
|                                          | 实收基金                            | 其他综合收益（若有） | 未分配利润          | 净资产合计              |
| 一、上期期末净资产                                | 3,421,851,872.45                | -          | -              | 3,421,851,872.45   |
| 加：会计政策变更                                 | -                               | -          | -              | -                  |
| 前期差错更正                                   | -                               | -          | -              | -                  |
| 其他                                       | -                               | -          | -              | -                  |
| 二、本期期初净资产                                | 3,421,851,872.45                | -          | -              | 3,421,851,872.45   |
| 三、本期增减变动                                 | 1,939,253,515.15                | -          | 0.00           | 1,939,253,515.15   |

|                                          |                    |   |                |                    |
|------------------------------------------|--------------------|---|----------------|--------------------|
| 额（减少以“-”号填列）                             |                    |   |                |                    |
| （一）、综合收益总额                               | -                  | - | 80,130,252.13  | 80,130,252.13      |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | 1,939,253,515.15   | - | -              | 1,939,253,515.15   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 25,132,340,661.32  | - | -              | 25,132,340,661.32  |
| 2. 基金赎回款                                 | -23,193,087,146.17 | - | -              | -23,193,087,146.17 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                  | - | -80,130,252.13 | -80,130,252.13     |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -                  | - | -              | -                  |
| 四、本期期末净资产                                | 5,361,105,387.60   | - | -              | 5,361,105,387.60   |

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：陈子成

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

博时合利货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]1371 号《关于准予博时合利货币市场基金注册的批复》核准，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时合利货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 200,167,138.20 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2016）第 845 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时合利货币市场基金基金合同》于 2016 年 8 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,167,141.63 份基金份额，其中认购资金利息折合 3.43 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据基金管理人于 2019 年 11 月 30 日发布的《博时基金管理有限公司关于博时合利货币市场基金增加基金份额类别并修改基金合同和托管协议的公告》，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2019 年 12 月 3 日起对本基金增加基金份额类别并相应修改基金合同。本基金对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成不同的基金份额类别。本基金设 A 类基金份额、B 类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，并分别公布各类基金份额的每万份基金净收益和七日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时合利货币市场基金基金合同》的有关规定，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。本基金的业绩比较基准为：活期存款利率（税后）。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2025 年 8 月 27 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 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。

#### 6.4.5 税项

##### （1）增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

## （2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

## （3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.6 重要财务报表项目的说明

### 6.4.6.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------|
| 活期存款  | 3,451,041.29           |
| 等于：本金 | 3,449,504.46           |

|                |                |
|----------------|----------------|
| 加：应计利息         | 1,536.83       |
| 减：坏账准备         | -              |
| 定期存款           | 901,209,999.83 |
| 等于：本金          | 900,000,000.00 |
| 加：应计利息         | 1,209,999.83   |
| 减：坏账准备         | -              |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -              |
| 存款期限 1-3 个月    | 701,012,833.14 |
| 存款期限 3 个月以上    | 200,197,166.69 |
| 其他存款           | -              |
| 等于：本金          | -              |
| 加：应计利息         | -              |
| 减：坏账准备         | -              |
| 合计             | 904,661,041.12 |

#### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |                  |              |         |
|--------|-------|------------------------|------------------|--------------|---------|
|        |       | 按实际利率计算的<br>账面价值       | 影子定价             | 偏离金额         | 偏离度 (%) |
| 债券     | 交易所市场 | 81,091,376.76          | 81,100,663.57    | 9,286.81     | 0.0002  |
|        | 银行间市场 | 4,752,862,931.91       | 4,754,895,991.78 | 2,033,059.87 | 0.0353  |
|        | 合计    | 4,833,954,308.67       | 4,835,996,655.35 | 2,042,346.68 | 0.0355  |
| 资产支持证券 |       | -                      | -                | -            | -       |
| 合计     |       | 4,833,954,308.67       | 4,835,996,655.35 | 2,042,346.68 | 0.0355  |

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%。

#### 6.4.6.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.6.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

#### 6.4.6.4 买入返售金融资产

##### 6.4.6.4.1 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<br>2025 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 | 805,545,871.49         | -         |
| 合计    | 805,545,871.49         | -         |

##### 6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.6.5 其他资产

无余额。

#### 6.4.6.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2025 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   | -                      |
| 应付交易费用      | 77,617.17              |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | 77,617.17              |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 188,478.95             |
| 合计          | 266,096.12             |

#### 6.4.6.7 实收基金

##### 博时合利货币 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |                 |
|---------------|----------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额            |
| 上年度末          | 187,688,560.56             | 187,688,560.56  |
| 本期申购          | 424,665,664.62             | 424,665,664.62  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -468,501,278.54            | -468,501,278.54 |
| 本期末           | 143,852,946.64             | 143,852,946.64  |

##### 博时合利货币 B

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |                    |
|---------------|----------------------------|--------------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额               |
| 上年度末          | 6,181,232,795.46           | 6,181,232,795.46   |
| 本期申购          | 28,945,083,080.26          | 28,945,083,080.26  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -29,516,678,821.97         | -29,516,678,821.97 |
| 本期末           | 5,609,637,053.75           | 5,609,637,053.75   |

注：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（如适用）

#### 6.4.6.8 未分配利润

##### 博时合利货币 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         | 0.00  | -     | 0.00    |
| 加：会计政策变更（若有） | -     | -     | -       |
| 前期差错更正（若有）   | -     | -     | -       |
| 其他（若有）       | -     | -     | -       |

|                |             |   |             |
|----------------|-------------|---|-------------|
| 本期期初           | -           | - | -           |
| 本期利润           | 952,503.59  | - | 952,503.59  |
| 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        | -952,503.59 | - | -952,503.59 |
| 本期末            | 0.00        | - | 0.00        |

**博时合利货币 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           | 0.00           | -     | 0.00           |
| 加：会计政策变更（若有）   | -              | -     | -              |
| 前期差错更正（若有）     | -              | -     | -              |
| 其他（若有）         | -              | -     | -              |
| 本期期初           | -              | -     | -              |
| 本期利润           | 49,373,644.99  | -     | 49,373,644.99  |
| 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        | -49,373,644.99 | -     | -49,373,644.99 |
| 本期末            | 0.00           | -     | 0.00           |

**6.4.6.9 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 340,781.04                            |
| 定期存款利息收入  | 4,287,683.29                          |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 45.92                                 |
| 其他        | 94,814.80                             |
| 合计        | 4,723,325.05                          |

**6.4.6.10 股票投资收益**

无发生额。

**6.4.6.11 债券投资收益**
**6.4.6.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 43,301,770.91              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 533,569.78                 |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                          |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                          |

|    |               |
|----|---------------|
| 合计 | 43,835,340.69 |
|----|---------------|

#### 6.4.6.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 6,340,401,532.93                      |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 6,327,929,143.98                      |
| 减：应计利息总额               | 11,938,819.17                         |
| 减：交易费用                 | —                                     |
| 买卖债券差价收入               | 533,569.78                            |

#### 6.4.6.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.6.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

##### 6.4.6.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

#### 6.4.6.13 衍生工具收益

##### 6.4.6.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

##### 6.4.6.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

#### 6.4.6.14 股利收益

无发生额。

#### 6.4.6.15 公允价值变动收益

无发生额。

#### 6.4.6.16 其他收入

无发生额。

#### 6.4.6.17 信用减值损失

无发生额。

#### 6.4.6.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用     | 39,671.58                  |
| 信息披露费    | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金  | —                          |
| 中债登账户维护费 | 9,000.00                   |
| 上清所账户维护费 | 9,600.00                   |
| 合计       | 117,778.95                 |

#### 6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

##### 6.4.7.2 资产负债表日后事项

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），规定自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

#### 6.4.8 关联方关系

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”）   | 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     |
| 博时财富基金销售有限公司（“博时财富”） | 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。

##### 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 6.4.9.2 关联方报酬

##### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 5,026,658.87               | 6,209,188.18                    |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 1,942,978.79               | 1,657,179.40                    |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 3,083,680.08               | 4,552,008.78                    |

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 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

##### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,675,552.96               | 2,069,729.47                    |

注：支付基金托管人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。

#### 6.4.9.2.3 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<br>2025年1月1日至2025年6月30日      |            |            |
|----------------|---------------------------------|------------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |            |
|                | 博时合利货币 A                        | 博时合利货币 B   | 合计         |
| 招商证券           | —                               | 44.83      | 44.83      |
| 招商银行           | 1,246.59                        | 417,649.05 | 418,895.64 |
| 博时基金           | 27.82                           | 70,873.14  | 70,900.96  |
| 博时财富           | 1,364.14                        | 24,756.89  | 26,121.03  |
| 合计             | 2,638.55                        | 513,323.91 | 515,962.46 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |            |
|                | 博时合利货币 A                        | 博时合利货币 B   | 合计         |
| 招商银行           | 18,236.50                       | 479,012.35 | 497,248.85 |
| 博时基金           | 84.97                           | 428,497.51 | 428,582.48 |
| 博时财富           | 1,348.01                        | 21,688.85  | 23,036.86  |
| 招商证券           | 0.08                            | 1,255.98   | 1,256.06   |
| 合计             | 19,669.56                       | 930,454.69 | 950,124.25 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类基金份额和 B 类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额和 B 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.03%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 A/B 类基金份额的基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

#### 6.4.9.3 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<br>2025年1月1日至2025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      |
| 招商银行股份有限公司                      | —      | —    | —     | —    | 313,087,000.00 | 18,550.23 |
| 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024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      |
| 招商银行股份有限公司                      | —      | —    | —     | —    | 71,101,000.00  | 3,684.51  |

#### 6.4.9.4 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

##### 6.4.9.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.9.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目                                | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |         | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |         |
|-----------------------------------|----------------------------|---------|---------------------------------|---------|
|                                   | 博时合利货币A                    | 博时合利货币B | 博时合利货币A                         | 博时合利货币B |
| 基金合同生效日<br>(2016年8月3日)<br>持有的基金份额 | -                          | -       | -                               | -       |
| 期初持有的基金份额                         | 1,096,789.78               | -       | 1,079,356.22                    | -       |
| 期间申购/买入总份额                        | 7,056.94                   | -       | 9,478.59                        | -       |
| 期间因拆分变动份额                         | -                          | -       | -                               | -       |
| 减：期间赎回/卖出总份额                      | -                          | -       | -                               | -       |
| 期末持有的基金份额                         | 1,103,846.72               | -       | 1,088,834.81                    | -       |
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例             | 0.02%                      | -       | 0.02%                           | -       |

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（如适用）。

2. 基金管理人博时基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

##### 6.4.9.5.2 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

#### 博时合利货币B

份额单位：份

| 关联方名称 | 博时合利货币B本期末<br>2025年6月30日 |                          | 博时合利货币B上年度末<br>2024年12月31日 |                      |
|-------|--------------------------|--------------------------|----------------------------|----------------------|
|       | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额                | 持有的基金份额占<br>基金总份额的比例 |
| 招商银行  | -                        | -                        | 504,424,069.24             | 7.92%                |

注：1. 除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

2. 持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

##### 6.4.9.6 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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |        | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024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 |

|           |              |           |                |            |
|-----------|--------------|-----------|----------------|------------|
| 招商银行-活期存款 | 3,451,039.53 | 44,293.17 | 241,544,989.77 | 110,609.20 |
|-----------|--------------|-----------|----------------|------------|

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

#### 6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期内，本基金买入 500,000 张托管人发行的同业存单，成交总额为 49,130,504.79 元（2024 年上半年：无交易）。

于本报告期末，本基金持有 500,000 张 25 招商银行 CD002，摊余成本总额为人民币 49,408,323.76 元，占基金资产净值的比例为 0.86%（上年度末：无）。

#### 6.4.10 利润分配情况

##### 1、博时合利货币 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 |
|--------------|---------------|-----------|------------|----|
| 954,865.93   | -             | -2,362.34 | 952,503.59 | -  |

##### 2、博时合利货币 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 |
|---------------|---------------|------------|---------------|----|
| 49,426,095.38 | -             | -52,450.39 | 49,373,644.99 | -  |

#### 6.4.11 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，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 900,330,046.25 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         |
|-----------|---------------|------------|--------|--------------|----------------|
| 112505190 | 25 建设银行 CD190 | 2025-07-04 | 99.89  | 2,000,000.00 | 199,770,498.60 |
| 112406280 | 24 交通银行 CD280 | 2025-07-01 | 99.65  | 1,474,000.00 | 146,888,936.10 |
| 240314    | 24 进出 14      | 2025-07-01 | 100.88 | 1,000,000.00 | 100,876,103.82 |
| 112406371 | 24 交通银行       | 2025-07-01 | 99.18  | 1,000,000.00 | 99,182,120.89  |

|           |                  |            |        |              |                |
|-----------|------------------|------------|--------|--------------|----------------|
|           | CD371            |            |        |              |                |
| 220207    | 22 国开 07         | 2025-07-01 | 101.97 | 700,000.00   | 71,380,550.72  |
| 240309    | 24 进出 09         | 2025-07-01 | 101.20 | 700,000.00   | 70,841,063.67  |
| 250206    | 25 国开 06         | 2025-07-01 | 100.35 | 700,000.00   | 70,247,298.36  |
| 240421    | 24 农发 21         | 2025-07-01 | 101.34 | 500,000.00   | 50,672,027.80  |
| 220412    | 22 农发 12         | 2025-07-01 | 101.98 | 400,000.00   | 40,791,733.70  |
| 150218    | 15 国开 18         | 2025-07-01 | 103.41 | 300,000.00   | 31,023,408.02  |
| 112506126 | 25 交通银行<br>CD126 | 2025-07-01 | 99.33  | 213,000.00   | 21,157,700.66  |
| 250201    | 25 国开 01         | 2025-07-01 | 100.25 | 200,000.00   | 20,049,516.29  |
| 112505204 | 25 建设银行<br>CD204 | 2025-07-04 | 99.81  | 128,000.00   | 12,775,622.59  |
| 257704    | 25 贴现国开 04       | 2025-07-01 | 99.78  | 13,000.00    | 1,297,162.87   |
| 合计        |                  |            |        | 9,328,000.00 | 936,953,744.09 |

#### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.12 金融工具风险及管理

##### 6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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。

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、法律合规部、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；法律合规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。

#### 6.4.12.2 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，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，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主要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，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约可能性很小；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，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。

##### 6.4.12.2.1 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<br>2025年6月30日 | 上年末<br>2024年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1    | 50,385,753.43     | 50,036,646.58      |
| A-1 以下 | —                 | —                  |
| 未评级    | 523,900,068.14    | 372,132,998.58     |
| 合计     | 574,285,821.57    | 422,169,645.16     |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

##### 6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.12.2.3 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<br>2025年6月30日 | 上年末<br>2024年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1    | —                 | —                  |
| A-1 以下 | —                 | —                  |
| 未评级    | 3,933,149,536.84  | 4,271,754,951.87   |
| 合计     | 3,933,149,536.84  | 4,271,754,951.87   |

##### 6.4.12.2.4 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<br>2025年6月30日 | 上年末<br>2024年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA    | 173,033,694.04    | 132,852,571.34     |
| AAA 以下 | —                 | —                  |
| 未评级    | 153,485,256.22    | 152,045,603.12     |

|    |                |                |
|----|----------------|----------------|
| 合计 | 326,518,950.26 | 284,898,174.46 |
|----|----------------|----------------|

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

#### 6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.12.3 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于开放期内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于开放期内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。

于本期末，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担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(净资产)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。

#### 6.4.12.3.1 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》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%。于本期末，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 2.07%，本基金投资组合的平均剩余期限为 81 天，平均剩余存续期为 81 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%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未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。

#### 6.4.12.4 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。

##### 6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

本基金的基金管理人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。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2025 年 6 月<br>30 日 | 6 个月以内                  | 6 个月-1 年              | 1-5 年    | 不计息                   | 合计                      |
|---------------------------|-------------------------|-----------------------|----------|-----------------------|-------------------------|
| <b>资产</b>                 |                         |                       |          |                       |                         |
| 货币资金                      | 904,661,041.12          | -                     | -        | -                     | 904,661,041.12          |
| 结算备付金                     | -                       | -                     | -        | -                     | -                       |
| 存出保证金                     | 1,098.00                | -                     | -        | -                     | 1,098.00                |
| 交易性金融资产                   | 4,496,806,764.51        | 337,147,544.16        | -        | -                     | 4,833,954,308.67        |
| 应收清算款                     | -                       | -                     | -        | 99,908,053.85         | 99,908,053.85           |
| 买入返售金融资产                  | 805,545,871.49          | -                     | -        | -                     | 805,545,871.49          |
| 应收申购款                     | -                       | -                     | -        | 11,769,338.47         | 11,769,338.47           |
| 应收股利                      | -                       | -                     | -        | -                     | -                       |
| 其他资产                      | -                       | -                     | -        | -                     | -                       |
| <b>资产总计</b>               | <b>6,207,014,775.12</b> | <b>337,147,544.16</b> | <b>-</b> | <b>111,677,392.32</b> | <b>6,655,839,711.60</b> |

|                                  |                         |                       |             |                       |                         |
|----------------------------------|-------------------------|-----------------------|-------------|-----------------------|-------------------------|
| <b>负债</b>                        |                         |                       |             |                       |                         |
| 卖出回购金<br>融资产款                    | 900,330,046.25          | -                     | -           | -                     | 900,330,046.25          |
| 应付赎回款                            | -                       | -                     | -           | 502.88                | 502.88                  |
| 应付清算款                            | -                       | -                     | -           | -                     | -                       |
| 应付管理人<br>报酬                      | -                       | -                     | -           | 980,723.66            | 980,723.66              |
| 应付托管费                            | -                       | -                     | -           | 326,907.89            | 326,907.89              |
| 应付销售服<br>务费                      | -                       | -                     | -           | 223,688.39            | 223,688.39              |
| 应交税费                             | -                       | -                     | -           | -                     | -                       |
| 应付利润                             | -                       | -                     | -           | 221,746.02            | 221,746.02              |
| 其他负债                             | -                       | -                     | -           | 266,096.12            | 266,096.12              |
| <b>负债总计</b>                      | <b>900,330,046.25</b>   | <b>-</b>              | <b>-</b>    | <b>2,019,664.96</b>   | <b>902,349,711.21</b>   |
| <b>利率敏感度<br/>缺口</b>              | <b>5,306,684,728.87</b> | <b>337,147,544.16</b> | <b>-</b>    | <b>109,657,727.36</b> | <b>5,753,490,000.39</b> |
| <b>上年度末<br/>2024年12月<br/>31日</b> | <b>6个月以内</b>            | <b>6个月-1年</b>         | <b>1-5年</b> | <b>不计息</b>            | <b>合计</b>               |
| <b>资产</b>                        |                         |                       |             |                       |                         |
| 货币资金                             | 707,821,662.23          | -                     | -           | -                     | 707,821,662.23          |
| 结算备付金                            | -                       | -                     | -           | -                     | -                       |
| 存出保证金                            | 4,512.31                | -                     | -           | -                     | 4,512.31                |
| 交易性金融<br>资产                      | 4,249,872,894.33        | 728,949,877.16        | -           | -                     | 4,978,822,771.49        |
| 应收清算款                            | -                       | -                     | -           | -                     | -                       |
| 买入返售金<br>融资产                     | 835,221,770.64          | -                     | -           | -                     | 835,221,770.64          |
| 应收申购款                            | -                       | -                     | -           | 116,474,853.23        | 116,474,853.23          |
| 应收股利                             | -                       | -                     | -           | -                     | -                       |
| 其他资产                             | -                       | -                     | -           | -                     | -                       |
| <b>资产总计</b>                      | <b>5,792,920,839.51</b> | <b>728,949,877.16</b> | <b>-</b>    | <b>116,474,853.23</b> | <b>6,638,345,569.90</b> |
| <b>负债</b>                        |                         |                       |             |                       |                         |
| 卖出回购金<br>融资产款                    | 267,082,294.02          | -                     | -           | -                     | 267,082,294.02          |
| 应付赎回款                            | -                       | -                     | -           | 164,789.82            | 164,789.82              |
| 应付清算款                            | -                       | -                     | -           | -                     | -                       |
| 应付管理人<br>报酬                      | -                       | -                     | -           | 1,078,391.54          | 1,078,391.54            |
| 应付托管费                            | -                       | -                     | -           | 359,463.86            | 359,463.86              |
| 应付销售服<br>务费                      | -                       | -                     | -           | 248,116.76            | 248,116.76              |
| 应交税费                             | -                       | -                     | -           | 22,155.31             | 22,155.31               |
| 应付利润                             | -                       | -                     | -           | 276,558.75            | 276,558.75              |
| 其他负债                             | -                       | -                     | -           | 192,443.82            | 192,443.82              |
| <b>负债总计</b>                      | <b>267,082,294.02</b>   | <b>-</b>              | <b>-</b>    | <b>2,341,919.86</b>   | <b>269,424,213.88</b>   |
| <b>利率敏感度</b>                     | <b>5,525,838,545.49</b> | <b>728,949,877.16</b> | <b>-</b>    | <b>114,132,933.37</b> | <b>6,368,921,356.02</b> |

|    |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|
| 缺口 |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|

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。

#### 6.4.12.4.1.2 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<br>2025 年 6 月 30 日       | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | 减少约 310                      | 减少约 475                  |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 增加约 311                      | 增加约 476                  |

#### 6.4.12.4.2 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。

#### 6.4.12.4.3 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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

##### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

#### 6.4.13 公允价值

##### 6.4.13.1 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。

##### 6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.13.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2025年6月30日 |
|---------------|-------------------|
| 第一层次          | —                 |
| 第二层次          | 4,833,954,308.67  |

|      |                  |
|------|------------------|
| 第三层次 | -                |
| 合计   | 4,833,954,308.67 |

#### 6.4.13.2 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。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.13.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.13.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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            | 4,833,954,308.67 | 72.63         |
|    | 其中：债券             | 4,833,954,308.67 | 72.63         |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 805,545,871.49   | 12.10         |
|    | 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      | 904,661,041.12   | 13.59         |
| 4  | 其他各项资产            | 111,678,490.32   | 1.68          |
| 5  | 合计                | 6,655,839,711.60 | 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 | 2.90          |            |
|    | 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 | 900,330,046.25 | 15.65 |
|   | 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    | 81  |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 118 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 50  |

### 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。

### 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                 | 28.64               | 15.65               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 23.95               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 29.13               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 1.05                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | 32.51               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 合计 |                        | 115.28              | 15.65               |

### 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                 | 按实际利率计算的账面价值     | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------------------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券                 | -                | -            |
| 2  | 央行票据                 | -                | -            |
| 3  | 金融债券                 | 709,547,065.42   | 12.33        |
|    | 其中：政策性金融债            | 486,127,617.95   | 8.45         |
| 4  | 企业债券                 | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券              | 191,257,706.41   | 3.32         |
| 6  | 中期票据                 | -                | -            |
| 7  | 同业存单                 | 3,933,149,536.84 | 68.36        |
| 8  | 其他                   | -                | -            |
| 9  | 合计                   | 4,833,954,308.67 | 84.02        |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -                | -            |

## 7.6 期末按实际利率计算账面价值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)   | 按实际利率计算的账面价值   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 112519183 | 25 恒丰银行 CD183 | 3,000,000 | 299,692,211.93 | 5.21         |
| 2  | 112515121 | 25 民生银行 CD121 | 3,000,000 | 299,233,875.29 | 5.20         |
| 3  | 112505190 | 25 建设银行 CD190 | 2,000,000 | 199,770,498.60 | 3.47         |
| 4  | 112505204 | 25 建设银行 CD204 | 2,000,000 | 199,619,103.03 | 3.47         |
| 5  | 112510117 | 25 兴业银行 CD117 | 2,000,000 | 199,359,756.69 | 3.47         |
| 6  | 112505249 | 25 建设银行 CD249 | 2,000,000 | 199,355,311.13 | 3.46         |
| 7  | 112406280 | 24 交通银行 CD280 | 2,000,000 | 199,306,561.87 | 3.46         |
| 8  | 112598726 | 25 温州银行 CD109 | 2,000,000 | 199,230,196.50 | 3.46         |
| 9  | 112519135 | 25 恒丰银行 CD135 | 2,000,000 | 198,761,032.13 | 3.45         |
| 10 | 112521154 | 25 渤海银行 CD154 | 2,000,000 | 198,758,271.95 | 3.45         |

## 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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                   | 0.0752%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0335% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0271%  |

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所有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。

## 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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行、国家外汇管理局温州市分局、国家金融监督管理总局珠海监管分局、漳州市市场监督管理局、福州市市场监督管理局的处罚。中国民生银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行、泉州金融监管分局的处罚。交通银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行辽宁省分行、国家外汇管理局北京市分局、国家金融监督管理总局湖北监管局、大同市云冈区住房和城乡建设局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行常德市分行、国家外汇管理局广西壮族自治区分局、国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。恒丰银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行、国家金融监督管理总局上海监管局的处罚。渤海银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行湖南省分行、国家金融监督管理总局青岛监管局的处罚。温州银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行温州市分行的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

### 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 | 1,098.00       |
| 2  | 应收清算款 | 99,908,053.85  |
| 3  | 应收利息  | —              |
| 4  | 应收申购款 | 11,769,338.47  |
| 5  | 其他应收款 | —              |
| 6  | 待摊费用  | —              |
| 7  | 其他    | —              |
| 8  | 合计    | 111,678,490.32 |

#### 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 |
| 博时合利货币 A | 14,220    | 10,116.24 | 18,171,981.61  | 12.63% | 125,680,965.03   | 87.37% |
| 博时合利货币 B | 819,511   | 6,845.10  | 466,007,200.89 | 8.31%  | 5,143,629,852.86 | 91.69% |
| 合计       | 833,426   | 6,903.42  | 484,179,182.50 | 8.42%  | 5,269,310,817.89 | 91.58% |

### 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  | 信托类机构 | 20,107,375.49 | 0.35%  |
| 2  | 基金类机构 | 16,386,466.76 | 0.28%  |
| 3  | 其他机构  | 14,160,672.35 | 0.25%  |
| 4  | 其他机构  | 13,703,144.30 | 0.24%  |
| 5  | 信托类机构 | 11,029,257.70 | 0.19%  |
| 6  | 其他机构  | 9,886,312.74  | 0.17%  |
| 7  | 其他机构  | 9,009,005.59  | 0.16%  |
| 8  | 基金类机构 | 8,551,209.89  | 0.15%  |
| 9  | 基金类机构 | 8,358,802.19  | 0.15%  |
| 10 | 信托类机构 | 8,001,692.28  | 0.14%  |

### 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 | 博时合利货币 A | —            | —        |
|                  | 博时合利货币 B | 1,185,110.28 | 0.02%    |
|                  | 合计       | 1,185,110.28 | 0.02%    |

### 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 | 博时合利货币 A | —                  |
|                                | 博时合利货币 B | 0~10               |
|                                | 合计       | 0~10               |

|                 |          |   |
|-----------------|----------|---|
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 博时合利货币 A | — |
|                 | 博时合利货币 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                                | 博时合利货币 A       | 博时合利货币 B          |
|-----------------------------------|----------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2016 年 8 月 3 日）<br>基金份额总额 | —              | 200,167,141.63    |
| 本报告期期初基金份额总额                      | 187,688,560.56 | 6,181,232,795.46  |
| 本报告期基金总申购份额                       | 424,665,664.62 | 28,945,083,080.26 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                     | 468,501,278.54 | 29,516,678,821.97 |
| 本报告期基金拆分变动份额                      | —              | —                 |
| 本报告期期末基金份额总额                      | 143,852,946.64 | 5,609,637,053.75  |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期内，无涉及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 2024 年起改聘安永华明会计师事务所（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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

### 10.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

## 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 |    |
| 国泰海通 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信建投 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序：

（1）本公司根据法规要求制定《博时基金公募基金证券交易佣金分配管理办法》，明确选择证券公司参与证券交易的标准和程序，并建立证券公司的准入管理机制，符合筛选标准的证券公司可纳入公司证券公司白名单库，并持续动态管理。

（2）本公司选择证券公司参与证券交易的主要标准是财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。严禁基金销售业务人员参与证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

（3）本公司建立公正公平的证券公司服务评价体系，在符合上述标准的证券公司中进行基金的证券交易佣金分配。主要程序：双方签署服务协议；证券公司提供交易和研究服务；公司每季度分别按照被动股票型基金和其他类型基金的服务评价规则，对证券公司进行服务评价，并按照评分排名确定佣金的分配资格和比例额度。

### 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 |
| 国泰海通 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中信建投 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

本基金在本报告期内不存在偏离度绝对值在 0.5%（含）以上的情况。

## 10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                                    | 法定披露方式                    | 法定披露日期     |
|----|---------------------------------------------------------|---------------------------|------------|
| 1  | 关于调整博时合利货币市场基金 B 类份额在东莞银行股份有限公司的申购、定期定额投资和转换转入业务金额限制的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-26 |
| 2  | 博时合利货币市场基金（博时合利货币 A）基金产品资料概要更新                          | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-26 |
| 3  | 博时合利货币市场基金（博时合利货币 B）基金产品资料概要更新                          | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-26 |
| 4  | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250606             | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-06 |
| 5  | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250603             | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-03 |
| 6  | 博时合利货币市场基金 2025 年第 1 季度报告                               | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-04-22 |
| 7  | 博时合利货币市场基金调整大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告                       | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-04-18 |
| 8  | 博时基金管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下公募基金的公告                         | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-04-08 |
| 9  | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250408             | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-04-08 |
| 10 | 博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）              | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-03-31 |
| 11 | 博时合利货币市场基金 2024 年年度报告                                   | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-03-31 |
| 12 | 博时合利货币市场基金调整大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告                       | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-03-26 |
| 13 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250325             | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-03-25 |
| 14 | 博时合利货币市场基金 2024 年第 4 季度报告                               | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-01-22 |

## § 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

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时合利货币市场基金设立的文件
- 2、《博时合利货币市场基金基金合同》
- 3、《博时合利货币市场基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时合利货币市场基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时合利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  
二〇二五年八月二十九日