博时现金收益证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2014年8月28日

§1重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

根据基金管理人2014年5月29日发布的《博时基金管理有限公司关于博时现金收益证券投资基金实施基金份额分类以及调整收益结转方式的公告》,博时现金收益证券投资基金自2014年6月3日实施基金份额分类以及调整收益结转方式,具体内容请查阅指定报刊上的各项相关公告。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	博时现金收益货币	
基金主代码	050003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004年1月16日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	35,153,801,364.76份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时现金收益货币A	博时现金收益货币B
下属分级基金的交易代码	050003	000665
报告期末下属分级基金的份额总额	17,190,381,151.25份	17,963,420,213.51份

2.2基金产品说明

投资目标	在保证低风险和高流动性的前提下获得高于投资基准的回报。
投资策略	本基金根据短期利率的变动和市场格局的变化,积极主动地在债券资产和回购资产之间进行动态的资产配置。
业绩比较基准	本基金成立于2004年1月16日,业绩比较基准是一年期定期存款利率(税后);自2009年7月1日起,本基金的业绩比较基准变更为:活期存款利率(税后)。
风险收益特征	现金收益证券投资基金投资于短期资金市场基础工具,由于这些金融工具的特点,因此整个基金的风险处于较低的水平。但是,本基金依然处于各种风险因素的暴露之中,包括利率风险、再投资风险、信用风险、操作风险、政策风险和通货膨胀风险等等。

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麟清	王涛
	联系电话	0755-83169999	95559
	电子邮箱	service@bosera.com	t_wang@bankcomm.com
客户服务电话		95105568	95559
传真		0755-83195140	021-62701216

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§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(2014年1月1日至2014年6月30日)	报告期(2014年6月4日至2014年6月30日)
	博时现金收益货币A	博时现金收益货币B
本期已实现收益	763,910,040.98	86,107,523.20
本期利润	763,910,040.98	86,107,523.20
本期净值收益率	2.5344%	0.3781%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
	博时现金收益货币A	博时现金收益货币B
期末基金资产净值	17,190,381,151.25	17,963,420,213.51
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、自2014年6月3日起对本基金实施基金份额分类以及调整收益结转方式,调整后,本基金的A、B基金份额采用统一的收益结转方式。通常情况下本基金的收益结转方式为按日结转,对于目前暂不支持按日结转的销售机构,仍保留按月结转的方式。基金份额分类后,本基金将分设A级和B级两类基金份额,两类基金份额单独设置基金代码,分别公布每万份基金净收益、七日年化收益率,并按照不同的费率计提销售服务费用。

3.2基金净值表现

3.2.1基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 博时现金收益货币A:

阶段	份额净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3937%	0.0051%	0.0292%	0.0000%	0.3645%	0.0051%
过去三个月	1.1841%	0.0029%	0.0885%	0.0000%	1.0956%	0.0029%
过去六个月	2.5344%	0.0026%	0.1760%	0.0000%	2.3584%	0.0026%
过去一年	4.8349%	0.0029%	0.3549%	0.0000%	4.4800%	0.0029%
过去三年	13.9342%	0.0038%	1.2110%	0.0002%	12.7232%	0.0036%
自基金成立起至今	37.7839%	0.0062%	14.8798%	0.0032%	22.9041%	0.0030%

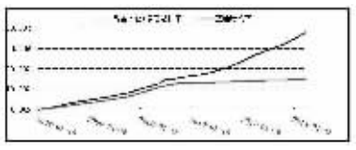
2. 博时现金收益货币B:

阶段	份额净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金成立起至今	0.3781%	0.0053%	0.0263%	0.0000%	0.3518%	0.0053%

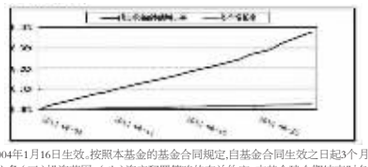
注:本基金成立于2004年1月16日,业绩比较基准是一年期定期存款利率(税后);
自2009年7月1日起,本基金的业绩比较基准变更为:活期存款利率(税后)。

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

1、博时现金收益货币A



2、博时现金收益货币B



注:本基金合同于2004年1月16日生效,按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十六条(三)投资范围、(八)资产配置策略的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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2014年6月30日,博时基金公司共管理四十七只开放式基金,并且受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金,以及多个企业年金账户,公募基金资产规模逾1041亿元人民币,累计分红超过628亿元人民币,是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一,养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计,标准股票型基金中,截至6月30日,博时医疗保健股票基金、博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名前1/4,博时主题行业股票基金今年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名前1/3。标准指数股票型基金中,博时沪深300指数、博时上证超大盘ETF、博时深证基本面200ETF三只基金今年以来净值增长率在150只同类基金中排名前1/2。混合基金方面,今年以来博时裕益收益率在35只灵活配置型同类基金中排名前1/2,博时平衡配置在16只股债平衡型同类基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时信用债纯债今年以来收益率在101只长期标准债券型基金中排名前1/4,博时安丰18个月定期开放基金排名前1/3,博时安益债券基金(A类)在6只中短期标准债券型基金中排名前1/2。

海外投资方面业绩方面,截至6月30日,博时亚洲票息收益债券基金在同类可比7只QDII债券基金中排名第1,博时大中华亚太精选今年以来收益率在9只QDII亚太股票型基金中排名第2,博时抗通胀在8只QDII商品基金中排名第2。

2、客户服务

2014年上半年,博时基金共举办各类渠道培训活动284场,参加人数7355人。

3、其他大事件

2014年1月9日,金融界网站在北京举办"第二届领航中国2013金融行业年度颁奖典礼",博时基金荣获"2013金融界领航中国年度评选基金公司最佳品牌奖"。

2014年1月11日,在和讯网主办的2013年第十一届财经风云榜基金行业评选中,博时基金荣获"2013年度基金业最佳投资者关系奖"。

2014年6月16日,大智慧在上海举办"智慧财经巅峰榜",博时基金荣获"十佳基金公司"奖项,基金经理张溪冈荣获智慧财经巅峰榜"最佳基金经理"奖项。

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		
张勇	基金经理-固定收益总部现金管理组投资总监	2006-7-1	-	10.5	2001年起先后在南京市商业银行任信贷员、债券交易员,2003年加入博时基金管理有限公司,历任债券交易员、基金经理助理、固定收益部副总经理、博时稳定价值债券投资基金的基金经理、现任固定收益总部现金管理组投资总监兼博时现金收益证券投资基金、博时策略灵活配置混合型证券投资基金、博时安盈债券型证券投资基金、博时宏观回报债券型证券投资基金的基金经理。

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管理人对投资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、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,本基金曾出现投资监控指标不符合基金合同约定的情况,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管理人对投资期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2014年上半年,国内经济整体处于一个下行趋势,市场是"宽货币,紧信用"的一个状态,房地产周期向下,但央行采取了定向降准、定向再贷款和PSL等微刺激,因此半年末的时候也并未出现去年同期的"钱荒"状况。信用风险在上半年得到了信用市场的广泛重点关注,市场风险偏好较低,高低评级债券的收益率分化较大。利率债方面,上半年国债和金融债都处于一个下行阶段,债券市场整体处于一个牛市。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

A类自2014年1月1日至报告期末,份额净值增长率为2.53%,业绩基准增长率为0.18%;B类自2014年6月4日至报告期末,份额净值增长率为0.38%,业绩基准增长率为0.03%。

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,在政策信号比较明确的刺激下,基本面和通胀都可能构成对债市的短期压力,但从中长期来看,在结构化的政策调控基调下,经济面临的下行压力仍将持续,对债市依然利好。短期的调整可视为适当的参与时点。短融和协议存款依然是我们投资的重点标的,今年因货币较为宽松,协议存款利率相对偏低,我们适当提高了债券投资的比例以取得更高的收益。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益,设立了博时基金管理有限公司估值委员会(以下简称"估值委员会"),制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成,基金经理原则上不参与估值委员会的工作,其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有5年以上专业工作经历,具备良好的专业经验和专业胜任能力,具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有:保证基金估值的公平、合理;制订健全、有效的估值政策和程序;确保对投资品种进行估时估值政策和程序的一贯性;定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金采用1.00元固定份额净值交易方式,自基金成立日起每日将实现的基金净收益分配给基金份额持有人。自2014年6月3日起对本基金实施基金份额分类以及调整收益结转方式,调整后,本基金的A、B基金份额采用统一的收益结转方式。通常情况下本基金的收益结转方式为按日结转,对于目前暂不支持按日结转的销售机构,仍保留按月结转的方式。基金份额分类后,本基金将分设A级和B级两类基金份额,两类基金份额单独设置基金代码。

本基金A类本报告期内向份额持有人分配利润763,910,040.98元,本基金B类自2014年6月4日至报告期末向份额持有人分配利润86,107,523.20元。

§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

2014年上半年度,托管人在博时现金收益货币市场基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2014年上半年度,博时基金管理有限公司在博时现金收益货币市场基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内向A级份额持有人分配利润:763,910,040.98元,自6月4日至本报告期末向B级份额持有人分配利润:86,107,523.20 元。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2014年上半年度,由博时基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关博时现金收益货币市场基金的半年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:博时现金收益证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	23,555,854,718.99	17,973,467,590.59
结算备付金	216,000,000.00	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	15,768,756,517.00	6,199,288,947.82
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	15,768,756,517.00	6,199,288,947.82
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	3,066,704,970.95
应收证券清算款	-	-
应收利息	359,386,400.74	220,147,341.30
应收股利	-	-
应收申购款	149,489,434.25	247,453,798.97
递延所得税资产	-	-
其他资产	95,000.00	95,000.00
资产总计	40,049,582,070.98	27,707,157,649.63
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	4,857,996,051.00	2,332,396,893.75
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	12,407,685.47	9,461,829.15
应付托管费	3,759,904.69	2,867,220.96
应付销售服务费	5,315,171.05	7,168,052.40
应付交易费用	234,512.42	105,802.46
应交税费	4,080,249.01	4,080,249.01
应付利息	397,453.66	281,656.24
应付利润	10,854,713.11	3,789,187.22
递延所得税负债	-	-
其他负债	734,965.81	249,071.28
负债合计	4,895,780,706.22	2,360,399,962.47
所有者权益:		
实收基金	35,153,801,364.76	25,346,757,687.16
未分配利润	-	-
所有者权益合计	35,153,801,364.76	25,346,757,687.16
负债和所有者权益总计	40,049,582,070.98	27,707,157,649.63

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额总额35,153,801,364.76份。其中A类基金份额净值1.0000元,基金份额总额17,190,381,151.25份;B类基金份额净值1.0000元,基金份额总额17,963,420,213.51份。

6.2利润表

会计主体:博时现金收益证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	1,007,200,403.08	931,969,896.14
1.利息收入	990,282,917.02	891,470,115.54
其中:存款利息收入	696,473,263.22	676,656,986.10
债券利息收入	258,834,649.24	213,715,629.68
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	34,975,004.56	1,097,499.76
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	16,917,486.06	40,499,780.60
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	16,917,486.06	40,499,780.60
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减:二、费用	157,182,838.90	185,594,072.78
1.管理人报酬	56,795,894.11	71,120,784.94
2.托管费	17,210,877.02	21,551,752.99
3.销售服务费	38,942,601.85	53,879,382.54
4.交易费用	-	-150.00
5.利息支出	43,956,849.67	38,768,638.76
其中:卖出回购金融资产支出	43,956,849.67	38,768,638.76
6.其他费用	276,616.25	273,663.55
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	850,017,564.18	746,375,823.36
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	850,017,564.18	746,375,823.36

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时现金收益证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	25,346,757,687.16	-	25,346,757,687.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	850,017,564.18	850,017,564.18
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)	9,807,043,677.60	-	9,807,043,677.60
其中:1.基金申购款	132,602,806,107.82	-	132,602,806,107.82
2.基金赎回款	-122,795,762,430.22	-	-122,795,762,430.22
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)	-	-850,017,564.18	-850,017,564.18
五、期末所有者权益(基金净值)	35,153,801,364.76	-	35,153,801,364.76
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	46,887,347,991.37	-	46,887,347,991.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	746,375,823.36	746,375,823.36
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)	-25,561,286,768.69	-	-25,561,286,768.69
其中:1.基金申购款	80,425,666,178.69	-	80,425,666,178.69
2.基金赎回款	-105,986,952,947.38	-	-105,986,952,947.38
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)	-	-746,375,823.36	-746,375,823.36
五、期末所有者权益(基金净值)	21,326,061,222.68	-	21,326,061,222.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:吴姚东　　主管会计工作的负责人: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报报告相一致。

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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入、债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司("博时基金")	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司("招商证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
中国长城资产管理公司	基金管理人的股东

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.4.2关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	56,795,894.11	71,120,784.94
其中:支付销售机构的客户维护费	6,938,674.94	12,797,563.16

注:支付基金管理人博时基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数。

6.4.4.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	17,210,877.02	21,551,752.99

注:支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.4.2.3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 2014年1月1日至2014年6月30日		
	博时现金收益货币A	博时现金收益货币B	合计
博时基金	15,378,403.75	161,475.54	15,539,879.29
交通银行	881,756.52	705.80	882,462.32
招商证券	744,497.47	-	744,497.47
合计	17,004,657.74	162,181.34	17,166,839.08
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	博时现金收益货币A	博时现金收益货币B	合计
博时基金	13,499,725.80	-	13,499,725.80
交通银行	1,768,605.36	-	1,768,605.36
招商证券	427,833.43	-	427,833.43
合计	15,696,164.59	-	15,696,164.59

注:支付销售机构的本基金A级销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,支付销售机构的本基金B级销售服务费按前一日基金资产净值0.01%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给博时基金,再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值 X 销售服务费率 / 当年天数。

6.4.4.3 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 2014年1月1日至2014年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	-	-	-	-	28,440,000,000.00	2,440,722.48
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	514,580,404.11	514,256,164.38	-	-	4,026,500,000.00	1,189,286.10

6.4.4.4各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	博时现金收益货币A	博时现金收益货币B	博时现金收益货币A	博时现金收益货币B
报告期初持有的基金份额	-	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	200,000,000.00	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	50,000,000.00	-	-
报告期末持有的基金份额	-	150,000,000.00	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.43%	-	-

注:本基金报告期末持有的包含红利再投、转换入的基金份额150,986,138.54。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

关联方名称	本期末 2014年6月30日			
	博时现金收益货币A		博时现金收益货币B	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券	-	-	400,320,876.00	1.14%
中国长城资产管理公司	-	-	495,519,782.03	1.41%
关联方名称	上年度可比期间 2013年12月31日			
	博时现金收益货币A		博时现金收益货币B	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券	130,025,231.21	0.51%	-	-

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行活期存款	854,718.99	530,082.40	34,333,300.22	275,431.18
交通银行定期存款	-	164,509,138.86	3,500,000,000.00	89,642,638.73

注:1、本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按约定利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按约定利率计息。于2014年6月30日的相关余额在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示 (2013年6月30日:同)。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期 2014年1月1日至2014年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
招商证券	041459042	14包钢集CP002	簿记建档集中配售	900,000	90,000,150.00
招商证券、交通银行	041459031	14北电CP001	簿记建档集中配售	1,000,000	100,000,300.00
招商证券	041458004	14澄星CP001	簿记建档集中配售	500,000	50,000,150.00
招商证券、交通银行	041451034	14大国资CP001	簿记建档集中配售	500,000	50,000,150.00
招商证券	071424005	14东兴证券CP005	簿记建档集中配售	500,000	49,987,500.00
招商证券、交通银行	071404004	14广发CP004	簿记建档集中配售	300,000	29,992,500.00
招商证券	140212	14国开12	簿记建档集中配售	2,000,000	200,200,000.00
招商证券	041452018	14航空技CP001	簿记建档集中配售	500,000	50,000,150.00
招商证券	041459008	14亨通CP001	簿记建档集中配售	300,000	30,000,150.00
招商证券	071433001	14华融证券CP001	簿记建档集中配售	1,000,000	99,975,000.00
招商证券	041458050	14南玻CP002	簿记建档集中配售	500,000	50,000,150.00
招商证券	041451024	14青岛港CP001	簿记建档集中配售	1,000,000	100,000,150.00
招商证券、交通银行	071415003	14申万CP003	簿记建档集中配售	2,000,000	199,950,800.00
招商证券、交通银行	041451016	14深能源CP001	簿记建档集中配售	500,000	50,000,150.00
招商证券、交通银行	041464024	14武水务CP001	簿记建档集中配售	1,000,000	100,000,150.00
招商证券、交通银行	041461040	14协鑫CP001	簿记建档集中配售	200,000	19,990,150.00
招商证券	041472008	14洋河CP002	簿记建档集中配售	300,000	30,000,150.00
招商证券	041452022	14渝水务CP002	簿记建档集中配售	900,000	89,955,150.00
招商证券	041459038	14中材起CP002	簿记建档集中配售	300,000	30,000,150.00
招商证券	041461036	14珠海九洲CP001	簿记建档集中配售	300,000	30,000,150.00
交通银行	041457002	14渝保税CP001	簿记建档集中配售	300,000	30,000,150.00
交通银行	041464042	14隆康元CP001	簿记建档集中配售	500,000	50,000,150.00
交通银行	041461037	14华电CP001	簿记建档集中配售	1,000,000	100,000,300.00
交通银行	041454033	14华侨城CP001	簿记建档集中配售	1,000,000	100,000,150.00
交通银行	041456029	14大唐新能CP001	簿记建档集中配售	1,000,000	100,000,300.00
交通银行	071406003	14安信CP003	簿记建档集中配售	1,000,000	99,975,000.00
交通银行	071416007	14华泰证券CP007	簿记建档集中配售	500,000	49,987,500.00
交通银行	041464038	14津地铁CP001	簿记建档集中配售	1,000,000	100,000,150.00
交通银行	041469029	14丰台国资CP001	簿记建档集中配售	1,000,000	99,995,300.00
交通银行	041466013	14深水务CP001	簿记建档集中配售	200,000	20,000,150.00
交通银行	041463013	14京煤CP001	簿记建档集中配售	1,000,000	99,990,300.00
交通银行	041461034	14万向CP001	簿记建档集中配售	1,000,000	100,000,150.00
交通银行	041458045	14福耀CP001	簿记建档集中配售	300,000	30,000,150.00
交通银行	041459037	14北电CP002	簿记建档集中配售	1,000,000	99,900,150.00
交通银行	041458010	14均瑶CP001	簿记建档集中配售	500,000	50,000,150.00
交通银行	041464032	14青岛城投CP001	簿记建档集中配售	1,000,000	100,000,300.00
交通银行	041464031	14新港CP001	簿记建档集中配售	500,000	50,000,150.00
交通银行	071405001	14证金CP001	簿记建档集中配售	1,000,000	99,975,000.00
交通银行	041461029	14滨建投CP002	簿记建档集中配售	2,000,000	200,000,150.00
交通银行	041458035	14深圳建发CP002	簿记建档集中配售	1,000,000	100,000,150.00
交通银行	041461022	14苏交通CP004	簿记建档集中配售	1,000,000	100,000,150.00
交通银行	041463009	14鲁高速股CP002	簿记建档集中配售	500,000	50,000,150.00
交通银行	041458029	14友谊CP001	簿记建档集中配售	1,000,000	99,800,150.00
交通银行	041458027	14苏广电CP001	簿记建档集中配售	1,000,000	100,000,150.00
交通银行	041452020	14南方水泥CP002	簿记建档集中配售	500,000	50,000,150.00
交通银行	041454022	14长电CP001	簿记建档集中配售