(上接B078版)

(97)万联证券有限责任公司
注册地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
办公地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层
法定代表人:张建军
联系人:王鑫
电话:020-38286686
传真:020-22373718-1013
客户服务电话:4008888133
网址:http://www.wlzq.cn
(98)华泰证券股份有限公司
注册地址:南京市江东中路228号
办公地址:办公地址南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦18楼
法定代表人:周易
联系人:庞晓芸
电话:0755-82492193
传真:0755-82492962(深圳)
客户服务电话:95597
网址:http://www.htsc.com.cn/
(99)山西证券股份有限公司
注册地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
联系人:郭熠
电话:0351-8686659
传真:0351-8686619
客户服务电话:4006661618
网址:http://www.i618.com.cn/
(100)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
法定代表人:杨宝林
联系人:吴忠超
电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
客户服务电话:95548
网址:http://www.citicssd.com
(101)东兴证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人:徐勇力
联系人:汤漫川
电话:010-66555316
传真:010-66555246
客户服务电话:4008888993
网址:http://www.dxzq.net
(102)东吴证券股份有限公司
注册地址:江苏省苏州市翠园路181号
办公地址:江苏省苏州市星阳街5号
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
客户服务电话:4008601555
网址:http://www.dwjq.com.cn
(103)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
联系人:尹旭航
电话:010-63081493
传真:010-63081344
客户服务电话:95321
网址:http://www.cindasc.com
(104)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
联系人:刘晨
电话:021-22169081
传真:021-22169134
客户服务电话:4008888788;95525
网址:http://www.ebscn.com/
(105)东北证券股份有限公司
注册地址:长春市生态大街6666号
办公地址:长春市生态大街6666号
法定代表人:李福春
联系人:安岩岩
电话:0431-85096517
传真:0431-85096795
客户服务电话:95360
网址:http://www.nesc.cn
(106)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市西藏中路336号
办公地址:上海市西藏中路336号
法定代表人:龚德雄
联系人:张瑾
电话:021-53519888
传真:021-63608830
客户服务电话:4008918918、021-962518
网址:www.962518.com
(107)大同证券有限责任公司
注册地址:大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址:太原市长治路111号山西世贸中心A座F12、F13
法定代表人:董祥
联系人:薛津
电话:0351-4130322
传真:0351-4192803
客户服务电话:4007121212
网址:http://www.dtsbc.com.cn
(108)浙商证券股份有限公司
注册地址:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
办公地址:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
法定代表人:吴承根
联系人:张智
电话:021-64718888
传真:0571-87901913
客户服务电话:95345
网址:http://www.stocke.com.cn/
(109)平安证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:广东省深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人:詹露阳
联系人:郑舒丽
电话:0755-22626172
传真:0755-82400862
客户服务电话:0755-22628888/95511
网址:http://www.pingan.com/
(110)华安证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址:安徽省合肥市南二环959号财智中心B1座
法定代表人:李工
联系人:甘霖
电话:0551-65161821
传真:0551-65161672
客户服务电话:0551-96518/4008096518
网址:http://www.hazq.com/
(111)国都证券有限责任公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:常喆
联系人:黄静
电话:010-84183333
传真:010-84183311-3389
客户服务电话:400-818-8118
网址:http://www.guodu.com
(112)东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:朱科敏
联系人:王一彦
电话:021-20333333
传真:021-50498825
客户服务电话:95531;4008888588
网址:http://www.longone.com.cn
(113)国盛证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市永叔路15号
办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
法定代表人:马跃进
联系人:汪代强
电话:0791-6285337
传真:0791-6289395
客户服务电话:4008222111
网址:http://www.gsstock.com/
(114)华西证券股份有限公司
注册地址:四川省成都市陕西街239号
办公地址:四川省成都市陕西街239号
法定代表人:杨炯阳
联系人:张曼
电话:010-68716150
传真:028-86150040
客户服务电话:4008888818
网址:http://www.hx168.com.cn
(115)申万宏源西部证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:李季
联系人:唐岚
电话:010-88085201
传真:010-88085195
客户服务电话:4008000562
网址:http://www.hysec.com
(116)中泰证券股份有限公司
注册地址:山东省济南市经十路20518号
办公地址:山东省济南市经七路86号23层
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0531-81283938
传真:0531-68889357
客户服务电话:95538
网址:www.zts.com.cn
(117)第一创业证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
法定代表人:刘学民
联系人:吴军
电话:0755-23838751
传真:0755-25838701
客户服务电话:95358
网址:https://www.firstcapital.com.cn/
(118)德邦证券股份有限公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人:方加春
联系人:罗芳
电话:021-68761616
传真:021-68767981
客户服务电话:4008888128
网址:http://www.tebon.com.cn
(119)西部证券股份有限公司
注册地址:陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16-17楼
办公地址:西安市西五路海惠大厦4层422室
法定代表人:刘建武
联系人:冯萍
电话:029-87406488
传真:029-87406387
客户服务电话:95582
网址:http://www.westsecu.com/
(120)华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富大厦
法定代表人:李晓安
联系人:李昕田
电话:0931-8888088
传真:0931-4890515
客户服务电话:0931-4890619489061848901 00
网址:http://www.hlzqgs.com/
(121)中国国际金融股份有限公司
注册地址:中国北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层
办公地址:中国北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层
法定代表人:李剑阁
联系人:王雪筠
电话:010-65051166
传真:010-65051156
客户服务电话:(010)85679238/85679169;(0755)83195000;(021)63861195;63861196
网址:http://www.cicc.com.cn/
(122)财通证券股份有限公司
注册地址:杭州市解放路111号
办公地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心1602室
法定代表人:沈继宁
联系人:董卿
电话:0571-87822359
传真:0571-87925100
客户服务电话:96336(上海地区962336)
网址:http://www.ctsec.com
(123)上海华信证券有限责任公司
注册地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
法定代表人:陈海平
联系人:李颖
电话:021-38784818
传真:021-38784818-8508
客户服务电话:021-38784818-8508
网址:www.shhxzq.com
(124)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
法定代表人:洪家新
联系人:陈敏
电话:021-64316642
传真:021-64333051
客户服务电话:95323、021-32109999、029-68918888
网址:http://www.cfsc.com.cn
(125)联讯证券股份有限公司
注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人:徐刚
联系人:陈思
电话:021-33606736
传真:021-33606760
客户服务电话:95564
网址:http://www.lxzq.com.cn
(126)江海证券有限公司
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
联系人:张背北
电话:0451-85863696
传真:0451-82287211
客户服务电话:4006662288
网址:http://www.jhzq.com.cn
(127)国金证券股份有限公司
注册地址:四川省成都市东城根上街95号
办公地址:四川省成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
联系人:刘婧漪、贾鹏
电话:028-86690057、028-86690058
传真:028-86690126
客户服务电话:4006-600109/95310
网址:http://www.gjzq.com.cn
(128)华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
法定代表人:陈林
联系人:刘闻川
电话:021-68777222
传真:021-68777822
客户服务电话:4008209898;021-38929908
网址:http://www.cnhbstock.com
(129)爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市南京西路758号23楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人:钱华
联系人:戴莉丽
电话:021-32229888
传真:021-68728703
客户服务电话:021-63340678
网址:http://www.ajzq.com
(130)英大证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人:吴骏
联系人:吴尔晖
电话:0755-83007159
传真:0755-83007034
客户服务电话:4000-188-688
网址:http://www.ydsc.com.cn
(131)首创证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座
办公地址:北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座
法定代表人:吴涛
客户服务电话:4006200620
网址:www.sczq.com.cn
(132)联储证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店B座26楼
办公地址:深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店B座26楼
法定代表人:沙常明
联系人:丁倩云
电话:010-56177851
传真:0755-82075835
客户服务电话:010-56177851
网址:http://www.lczq.com/
(133)泉州银行股份有限公司
注册地址:泉州市丰泽区云鹿路3号
办公地址:泉州市丰泽区云鹿路3号
法定代表人:傅子能
联系人:董培姗
电话:0595-22551071
传真:0595-22505215
客户服务电话:400-889-6312
网址:www.qzccbank.com
(134)华融湘江银行股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区芙蓉南路一段828号鑫远-杰座大厦
办公地址:湖南省长沙市天心区芙蓉南路一段828号鑫远-杰座大厦
法定代表人:刘永生
联系人:张鹏君
电话:0731-96599
传真:0731-89828806
客户服务电话:0731-96599
网址:www.hrxjbank.com.cn
(135)龙江银行股份有限公司
注册地址:黑龙江省哈尔滨市道里区友谊路436号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市道里区友谊路436号
法定代表人:张建辉
联系人:闫勇
电话:0451-85706107
传真:0451-85706107
客户服务电话:4006458888
网址:www.lj-bank.com
(136)桂林银行股份有限公司
注册地址:桂林市中山南路76号
办公地址:桂林市中山南路76号
法定代表人:王能
联系人:周佩玲
电话:0773-3810130
传真:0773-3851691
客户服务电话:400-86-96299
网址:www.guilinbank.com.cn
(137)德州银行股份有限公司
注册地址:山东省德州市三八东路1266号
办公地址:山东省德州市三八东路1266号
法定代表人:孙玉芝
联系人:王方震
电话:0534-2297326
传真:0534-2297327
客户服务电话:40084-96588
网址:www.dzbchina.com
(138)宁夏银行股份有限公司
注册地址:宁夏银川市金凤区北京中路157号
办公地址:宁夏银川市金凤区北京中路157号
法定代表人:道月泓
联系人:蒋阳
电话:0951-5165256
传真:0951-5165256
客户服务电话:400-809-6558
网址:http://www.bankofnx.com.cn
(139)湖北银行股份有限公司
注册地址:武汉市武昌区水果湖街中北路86号汉街总部国际8栋
办公地址:武汉市武昌区水果湖街中北路86号汉街总部国际8栋
法定代表人:陈大林
联系人:李昕雅
电话:027-87139129
传真:027-87135931
客户服务电话:(湖北)96599(全国)400-85-96599
网址:http://www.hubeibank.cn

二、登记机构

名称: 博时基金管理有限公司
住所: 广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层
办公地址: 北京市建国门内大街18号恒基中心1座23层
法定代表人:张光华
电话: 010-65171166
传真: 010-65187068
联系人: 许鹏

三、出具法律意见书的律师事务所

名称: 上海市通力律师事务所
注册地址: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人: 俞卫锋
电话: 021- 31358666
传真: 021- 31358600
联系人: 安冬
经办律师: 安冬、孙睿

四、审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:林佳璐
经办注册会计师:张振波、林佳璐

四、基金名称

博时天天增利货币市场基金

五、基金类型

货币型

六、基金运作方式

契约型开放式

七、基金的投资目标

在保持相对低风险和相对高流动性的前提下获得高于业绩比较基准的回报。

八、基金的投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单,剩余期限在397天以内(含397天)的企业债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具,以及中国证监会及/或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。

未来若法律法规或监管机构允许基金投资其他基金的,在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的条件下,履行适当程序后,本基金可参与其他货币市场基金的投资,具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

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

九、基金的投资策略

本基金在资产配置时应充分考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,在风险与收益的配比中,力求降低各类风险,并争取在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。

(一)资产配置策略

本基金将深入研究宏观经济状况、政策变化趋势、市场资金供求状况等,通过自上而下和自下而上相结合,充分运用收益率策略与估值策略相结合的方法,对各类可投资资产进行合理的配置和选择,同时控制组合内资产的平均剩余期限在120天以内。

(二)利率策略

在宏观分析与流动性分析的基础上,结合历史与经验数据,通过定性分析与定量分析相结合的方法,判断当前资金的时间价值、通货膨胀补偿、流动性溢价、收益率曲线等,进而对短期利率的变化态势做出及时反应,并据此动态调整投资组合。

(三)回购配置策略

在长期、中期和短期回购资产类属配置层上,强调通过对中长期回购利率波动规律的把握对回购资产进行时间方向上的动态配置策略。同时根据回购利差进行回购品种的配置比例调整。

(四)个券选择策略

在短期债券的个券选择上利用收益率利差策略、收益率曲线策略以及含权债券价值变动策略选择收益高或价值低估的短期债券,进行投资决策。

(五)银行定期存款及大额存单投资策略

银行定期存款及大额存单的投资将是本基金关注的目标之一。具体而言,在组合投资过程中,本基金将在综合考虑成本收益的基础上,根据不同银行的银行存款收益率情况,结合银行的信用等级、存款期限等因素的分析,以及对整体利率市场环境及其变动趋势的研究,在严格控制风险的前提下选择具有较高投资价值的银行存款进行投资。并且尽可能的扩大交易对手方的覆盖范围,挖掘出利率报价较高的多家银行进行银行定期存款及大额存单的投资,在获取较高投资收益的同时尽量分散投资风险,提高存款及存单资产的流动性。

(六)流动性管理策略

本基金将综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例,通过现金留存、控制回业存款的比例、持有高流动性券种、正向回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性。并且,在日常投资管理中,本基金将会紧密关注申赎现金流变化情况、季节性资金流动等影响货币市场基金流动性管理的因素。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准拟为:七天通知存款税后利率

本基金定位为现金管理工具,根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金采用七天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场出现更加适合用于本基金的业绩比较基准,在与基金托管人协商一致后,本基金管理人可以在报中国证监会备案后调整或变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十一、基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的较低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

十二、基金投资组合报告

博时基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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

本投资组合报告所载数据截至2017年12月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,233,377,587.38	55.55
	其中:债券	1,203,377,587.38	54.20
	资产支持证券	30,000,000.00	1.35
2	买入返售金融资产	338,301,827.44	15.24
	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	634,132,511.07	28.56
4	其他资产	14,483,292.09	0.65
5	合计	2,220,295,217.98	100.00

2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.44	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2017-12-20	20.05	巨额赎回	1个交易日

3 基金投资组合平均剩余期限

3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	42
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	59
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	25

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限没有超过120天的情况

3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	54.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	13.65	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	23.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	6.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	1.35	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.44	-

4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限没有超过240天的情况

5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	149,714,162.76	6.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	240,036,990.86	10.82
	其中:政策性金融债	240,036,990.86	10.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	813,626,433.76	36.68
8	其他	-	-
9	合计	1,203,377,587.38	54.25
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111711479	17平安银行CD479	2,000,000	198,864,825.31	8.97
2	111707240	17招商银行CD240	2,000,000	198,281,628.84	8.94
3	179949	17贴现国债49	1,500,000	149,714,162.76	6.75
4	170203	17国开03	1,300,000	129,981,656.86	5.86
5	111785726	17成都农商银行CD045	1,200,000	118,750,479.90	5.35
6	111781415	17盛京银行CD163	1,000,000	99,790,692.30	4.50
7	111770446	17天津银行CD255	1,000,000	99,101,516.92	4.47
8	111713061	17浙商银行CD061	1,000,000	98,837,290.49	4.46
9	150207	15国开07	500,000	50,058,340.17	2.26
10	170401	17农发01	500,000	49,996,742.13	2.25

7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0144%
报告期内偏离度的最低值	-0.0614%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0187%

注:上表中"偏离情况"根据报告期内各工作日数据计算。

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未超过0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未超过0.5%。

8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	146129	花呗27A1	300,000.00	30,000,000.00	1.35

9 投资组合报告附注

9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持1.00元。

9.2 本报告期内,本基金投资的前十名证券中除17平安银行CD479(111711479)的发行主体平安银行(000001)外,没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

中国银监会于2017年3月29日发布公告称,因平安银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则等原因,被中国银监会处以罚款的行政处罚。

9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	14,266,095.83
4	应收申购款	217,196.26
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	14,483,292.09

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。

十三、基金的业绩

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

自基金合同生效开始,基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、博时天天增利货币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
2014.8.25-2014.12.31	1.5021%	0.0070%	0.4771%	0.0000%	1.0250%	0.0070%
2015.1.1-2015.12.31	3.2372%	0.0050%	1.3500%	0.0000%	1.8872%	0.0050%
2016.1.1-2016.12.31	2.4510%	0.0036%	1.3500%	0.0000%	1.1010%	0.0036%
2017.1.1-2017.12.31	3.4584%	0.0010%	1.3500%	0.0000%	2.1084%	0.0010%
2014.8.25-2017.12.31	11.0692%	0.0044%	4.5271%	0.0000%	6.5421%	0.0044%

2、博时天天增利货币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
2014.8.25-2014.12.31	1.5884%	0.0070%	0.4771%	0.0000%	1.1113%	0.0070%
2015.1.1-2015.12.31	3.4861%	0.0050%	1.3500%	0.0000%	2.1361%	0.0050%
2016.1.1-2016.12.31	2.6960%	0.0036%	1.3500%	0.0000%	1.3460%	0.0036%
2017.1.1-2017.12.31	3.7089%	0.0010%	1.3500%	0.0000%	2.3589%	0.0010%
2014.8.25-2017.12.31	11.9684%	0.0044%	4.5271%	0.0000%	7.4413%	0.0044%

十四、基金费用与税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、销售服务费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、基金的开户费用和账户维护费用;

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.33%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人自动于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人自动于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3.基金销售服务费

本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%,对于由B类降级为A类的基金份额持有人,年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额的费率。B类基金份额的年销售服务费率为0.01%,对于由A类升级为B类的基金份额持有人,年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受B类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同,具体如下:

H=E×年销售服务费率÷当年天数

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人自动于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付登记机构,由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。

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

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金管理人于2017年10月9日刊登的本基金原招募说明书(《博时天天增利货币市场基金更新招募说明书2017年第2号》)进行了更新,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要补充和更新的内容如下:

1、在"三、基金管理人"中,对基金管理人的基本情况进行了更新;

2、在"四、基金托管人"中,对基金托管人的基本情况进行了更新;

3、在"五、相关服务机构"中,更新了相关服务机构的内容,各新增代销机构均在指定媒体上公告列示,更新了会计师事务所的内容;

4、在"九、基金的投资"中,更新了投资范围、投资限制、投资组合平均剩余期限计算方法、基金投资组合报告"的内容,数据内容截止时间为2017年12月31日;

5、在"十、基金的业绩"中,更新了"自基金合同生效开始基金份额净值增长率"的数据及列表内容,数据内容截止时间为2017年12月31日;

6、在"二十二、其它应披露的事项"中根据最新情况对相关应披露事项进行了更新:

(一)、2018年02月02日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时天天增利货币市场基金2018年"春节"假期前暂停申购、转换转入公告》;

(二)、2018年01月29日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加成都华羿恒信财富投资管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》;

(三)、2018年01月23日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时基金管理有限公司关于调整货币市场基金快速赎回额度的公告》;

(四)、2018年01月20日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时天天增利货币市场基金2017年第4季度报告》;

(五)、2018年01月19日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加宁夏银行股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》;

(六)、2017年12月29日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加深圳前海汇联基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》;

(七)、2017年12月26日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时基金管理有限公司关于调整货币市场基金快速赎回额度的公告》;

(八)、2017年12月22日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时天天增利基金新增安信证券为代销机构的公告》;

(九)、2017年12月13日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时天天增利货币市场基金增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为代销机构的公告》;

(十)、2017年12月06日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加龙江银行股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》、《20171204关于博时旗下部分开放式基金增加华泰证券股份有限公司为代销机构的公告》;

(十一)、2017年11月24日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加通华财富(上海)基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》;

(十二)、2017年11月23日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于江西正融资产管理有限公司暂停代理博时天天增利货币市场基金A类份额销售业务的公告》;

(十三)、2017年11月21日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加洪泰财富(青岛)基金销售有限责任公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》;

(十四)、2017年11月20日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加上海联泰资产管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》;

(十五)、2017年11月16日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加大河财富基金销售有限公司为代销机构的公告》;

(十六)、2017年10月27日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时天天增利货币市场基金2017年第3季度报告》;

(十七)、2017年10月09日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时天天增利货币市场基金更新招募说明书2017年第2号(摘要)》;

(十八)、2017年09月27日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加深圳众禄金融控股股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》;

(十九)、2017年09月25日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加深圳盈信基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》;

(二十)、2017年09月22日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加广发银行股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》;

(二十一)、2017年09月01日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加联储证券有限责任公司为代销机构的公告》;

(二十二)