博时特许价值股票型证券投资基金

【2014】第四季度报告

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月21日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月20日复核了本报告中的财务指标、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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时特许价值股票
基金主代码	050010
交易代码	050010(前端) 051010(后端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年5月28日
报告期末基金份额总额	382,151,791.32份
投资目标	本基金的投资目标在于分享中国经济高速发展过程中那些具有政府壁垒优势、技术壁垒优势、市场与品牌壁垒优势的企业所带来的持续投资收益,为基金持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金实行风险管理下的主动型价值投资策略,即采用以精选个股为核心的多层次复合投资策略。在战略上,强调自上而下的组合管理;在战术上,强调自下而上的精选个股。具体投资策略为:在资产配置和组合管理方面,利用金融工程手段和投资组合管理技术,保持组合流动性;在选股层面,按照价值投资原则,利用研究人员的专业研究能力和金融工程的财务数据处理能力,从品质过滤和价值精选两个阶段来精选个股,选择价值被低估且具有政府壁垒优势、技术壁垒优势、市场壁垒优势或者品牌壁垒优势等持续增长潜力的股票,作为构建股票组合的基础。本基金的投资策略具有三层结构,即自上而下的资产配置、自上而下的行业选择和自下而上的选股或选债策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:80%×沪深300指数收益率+20%×中国债券总指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于预期风险收益较高的基金品种,其预期风险和预期收益高于债券型基金和混合型基金。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	58,067,791.44
2.本期利润	153,118,199.39
3.加权平均基金份额本期利润	0.4198
4.期末基金资产净值	575,153,401.58
5.期末基金份额净值	1.505

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。

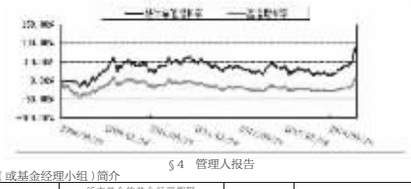
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	38.84%	1.62%	35.05%	1.32%	3.79%	0.30%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵云阳	基金经理	2013-9-13	-	4	2003年至2010年在晨星中国研究中心工作。2010年8月加入博时基金管理有限公司,历任股票投资部量化分析师、博时标普500指数基金基金经理助理和博时深证基本面200ETF基金及其联接基金基金经理助理。现任博时深证基本面200ETF基金及其联接基金、博时上证企债30ETF基金、博时特许价值股票基金的基金经理。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《博时特许价值股票型证券投资基金基金合同》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,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3公平交易专项说明

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报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年4季度经过10月份的小幅震荡,11月开始市场显著转入了大盘蓝筹风格为主导的结构性上涨。上证50涨幅超过55%,沪深300涨幅大于41%,而中小板和创业板表现转弱,分别下跌3.81%和5.24%。行业板块方面,在稳增长政策加码、无风险利率逐步下行的环境中,证券、保险等非银金融以及建筑、钢铁、航运、地产等周期性行业伴随市场风格的转换轮番表现。本基金始终坚持价值投资理念,维持着较高的价值股配置比例;报告期内根据我们的量化跟踪模型,利用市场规律及其变化,进一步减少了基金在小盘股的配置比例,增加了金融和周期行业的配置,降低了组合股票持仓的平均估值水平,提升了大盘蓝筹风格的特征,在12月份的行情获得了一定的回报。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,本基金份额净值为1.505元,份额累计净值为1.850元,报告期内净值增长率为38.84%,同期业绩基准涨幅为35.05%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年1季度,宏观层面,经济增长虽弱但是下行风险有限,市场无风险利率的进一步下行是大概率事件;政策方面,政府推进国企改革进入关键阶段,货币政策和财政政策在稳增长的预期下维持相对宽松;市场层面,2014年底的大盘牛市提高了投资者的风险偏好,增量资金逐步入市,股指期权等衍生产品可能会推出,股票发行注册制可能进入实施阶段。这些因素对大盘多是正面的影响。同时,四季度的风格急剧转换也进一步提高了市场的波动性,2015年1季度这种波动性还将持续。

4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1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	权益投资	524,066,923.84	89.63
	其中:股票	524,066,923.84	89.63
2	固定收益投资	9,847,273.80	1.68
	其中:债券	9,847,273.80	1.68
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	26,729,697.72	4.57
7	其他资产	24,074,377.51	4.12
8	合计	584,718,272.87	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,846,671.08	0.32
B	采矿业	28,925,588.46	5.03
C	制造业	121,254,815.34	21.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,346,346.72	0.58
E	建筑业	26,290,308.00	4.57
F	批发和零售业	61,045,054.84	10.61
G	交通运输、仓储和邮政业	19,273,890.72	3.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,179,846.28	0.73
J	金融业	217,570,636.54	37.83
K	房地产业	33,642,028.94	5.85
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,954,526.87	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	539,478.00	0.09
S	综合	3,197,732.05	0.56
	合计	524,066,923.84	91.12

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	1,894,304	31,256,016.00	5.43
2	600739	辽宁成大	1,400,916	30,105,684.84	5.23
3	601318	中国平安	369,600	27,612,816.00	4.80
4	600153	建发股份	2,483,073	25,277,683.14	4.39
5	600000	浦发银行	1,550,656	24,329,792.64	4.23
6	600016	民生银行	2,144,276	23,329,722.88	4.06
7	601668	中国建筑	3,124,300	22,744,904.00	3.95
8	000001	平安银行	1,263,940	20,020,809.60	3.48
9	601088	中国神华	848,614	17,218,378.06	2.99
10	600048	保利地产	1,372,383	14,849,184.06	2.58

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	441,063.30	0.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	9,406,210.50	1.64
8	其他	-	-
9	合计	9,847,273.80	1.71

5.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	32,000	4,774,080.00	0.83
2	110015	石化转债	33,000	4,452,360.00	0.77
3	010501	05国债(1)	4,390	441,063.30	0.08
4	110027	东方转债	1,050	179,770.50	0.03

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持仓股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持仓国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体除中国石油化工股份有限公司(石化转债)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。

中国石油化工股份有限公司于2014年1月12日发布公告称,国务院对山东省青岛市“1122”中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告作出批复,同意国务院事故调查组的调查处理结果,认定是一起特别重大责任事故;同意对事故有关责任单位和责任人的处理建议,对中国石化及当地政府的 48 名责任人分别给予纪律处分,对涉嫌犯罪的 15 名责任人移送司法机关依法追究法律责任。

对该债券投资决策程序的说明:

根据我司的基金投资管理相关制度,以相应的研究报告为基础,结合其未来增长前景,由基金经理决定具体投资行为。

5.11.2报告期内基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	139,439.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	56,088.10
5	应收申购款	23,878,849.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,074,377.51

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	4,774,080.00	0.83
2	110015	石化转债	4,452,360.00	0.77

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	380,319,887.30
报告期期间基金总申购份额	115,056,374.39
减:报告期期间基金总赎回份额	113,224,470.37
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	382,151,791.32

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8影响投资者决策的其他重要信息

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12月31日,博时基金公司共管理五十三只开放式基金,并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金,以及多个企业年金账户。博时基金资产管理净值总规模逾2363亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1124亿元人民币,累计分红超过638亿元人民币,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12月31日,博时主题行业股票基金今年以来净值增长率在365只标准型股票基金中排名第6,博时特许价值股票基金今年以来净值增长率在365只标准型股票基金中排名第12;博时精选股票基金在7只同类普通股票型基金中排名前1/2;博时裕富沪深300指数基金在同类150只标准指数股票型基金中排名前1/5,博时上证超大盘ETF及博时深证基本面200ETF在150只标准指数股票型基金中均排名前1/2;博时上证超级大盘ETF联接及博时深证基本面200ETF联接在同类45只产品中排名前1/2。混合基金中,博时裕益灵活配置混合在34只灵活配置型基金中排名前1/4,博时价值增长混合及博时价值增长贰号混合在同类29只产品中排名前1/2;博时平衡配置混合在同类16只产品中排名前1/2。

固定收益方面,博时信用债券(A/B类)今年以来收益率在93只同类普通债券型基金中排名第1;博时信用债券(C类)今年以来收益率在56只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(B类)今年以来收益率在41只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(A类)今年以来收益率在67只同类普通债券型基金中排名第2;博时转债增强债券(A类)今年以来收益率在13只可转换债券基金中排名第3;博时安丰18个月定期开放基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/3,博时信用债纯债债券基金、博时安心收益定期开放债券(A类)及博时月月薪定期支付债券基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/2;博时宏观回报债券(A/B类)及博时天颐债券(A类)在93只同类普通债券型基金中分别排名第7、第8;博时现金收益货币(A类)在78只同类货币市场基金中排名前1/2。

海外投资方面业绩方面,截至12月31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,博时抗通胀在8只QDII商品基金中排名第1。

2、客户服务

2014年四季度,博时基金共举办各类渠道培训活动219场,参加人数6102人。

3、其他大事件

2014年12月18日,博时国际获得和讯海外财经风云榜“2014年度最佳中资基金公司奖”;

2014年12月25日,博时基金获得金融界评选的“最佳品牌奖”。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

9.1.1中国证券监督管理委员会批准博时特许价值股票型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时特许价值股票型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时特许价值股票型证券投资基金托管协议》

9.1.4基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.1.5博时特许价值股票型证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6报告期内博时特许价值股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2存放地点:

基金管理人、基金托管人处

9.3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
2015年1月21日

博时天天增利货币市场基金

【2014】第四季度报告

博时天天增利货币市场基金
2014年第4季度报告
2014年12月31日
基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月21日

§1重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月20日复核了本报告中的财务指标、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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

§2基金产品概况

基金简称	博时天天增利货币	
基金主代码	000734	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年8月25日	
报告期末基金份额总额	2,128,069,618.30份	
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。	
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。	
业绩比较基准	七天通知存款税后利率	
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。	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博时天天增利货币A	博时天天增利货币B
下属分级基金的交易代码	000734	000735
报告期末下属分级基金的份额总额	329,109,180.60份	1,798,960,437.70份

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)	
	博时天天增利货币A	博时天天增利货币B
1.本期已实现收益	3,433,716.60	13,598,584.47
2.本期利润	3,433,716.60	13,598,584.47
3.期末基金资产净值	329,109,180.60	1,798,960,437.70

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 本报告期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、博时天天增利货币A:

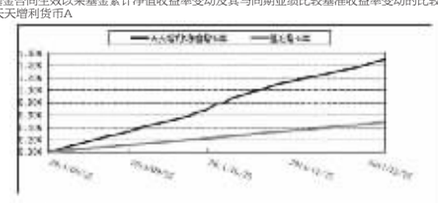
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0939%	0.0082%	0.3403%	0.0000%	0.7536%	0.0082%

2、博时天天增利货币B:

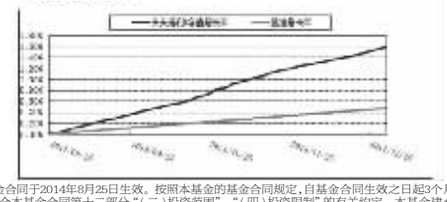
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1550%	0.0082%	0.3403%	0.0000%	0.8147%	0.0082%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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. 博时天天增利货币A



2. 博时天天增利货币B



注:本基金合同于2014年8月25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十二部分“(二)投资范围”、“(四)投资限制”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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2014-8-25	-	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、博时安益债券型证券投资基金、博时宏观回报债券型证券投资基金、博时天天增利货币市场基金、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金、博时现金宝货币市场基金、博时保证金实时交易型货币市场基金的基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《博时天天增利货币市场基金基金合同》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,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 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年第四季度,货币市场流动性前松后紧,从11月下旬新股扰动开始,一直延续到年底,资金面总体偏紧。银行间R001均值2.66%(-37BP),R007均值3.46%(-13BP)。现券市场先扬后抑,收益率曲线扁平化上移,短端由于年末资金趋紧出现倒挂,信用利差有所扩大。1年期短融收益率分别为4.86%(AAA)、5.48%(AA+)、5.87%(AA)。

四季度,本基金秉承现金管理工具的流动性和安全性原则,大类资产配置以存款和短融为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,本基金A类基金份额净值增长率为1.09%,B类基金份额净值增长率为1.16%,同期业绩基准增长率0.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

期限利差较为平坦反映的是短期利率不断下降的预期,年后随着财政资金的大幅投放和短期因素的消失,资金面的边际改善可期。我们认为,货币政策基调并未改变,改变的仅仅是市场的预期。利率市场化推进中,货币政策灵活性加大。央行“弹性利率走廊+中期政策利率”的调控方式将延续,货币市场波动性将维持低位。展望2015年一季度,政策宽松预期将有所修复,全面降准的可能性正在显著上升,资金面缓解的格局很可能延续到春节之前。受此影响,利率债收益率将率先下行,而期限利差将会首先修复。受中登事件和地方债务甄别影响,信用利差的修复可能相对滞后。重点关注流动性压力缓解后的估值修复,收益率曲线短端的机会较为明显。

本基金将坚持作为流动性管理工具的定位,继续保持投资组合良好的流动性和较短的组合期限。未来一段时间,票息收入将有所增加,我们将提高债券占比,相对降低存款与逆回购的投资力度。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

§5投资组合报告

5.1 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	904,794,100.54	40.43
	其中:债券	904,794,100.54	40.43
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	835,302,092.95	37.32
	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	480,694,941.95	21.48
4	其他资产	17,334,233.51	0.77
5	合计	2,238,125,368.95	100.00

5.2 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	10.36	
	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	108,999,436.50	5.12
	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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	97
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	125
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	52

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 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	50.56	5.12
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	15.52	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	1.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	8.00	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	28.39	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	104.36	5.12

5.4 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	109,802,252.33	5.16
	其中:政策性金融债	109,802,252.33	5.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	794,991,848.21	37.36
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	904,794,100.54	42.52
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.5 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	011462003	14葛洲坝SCP003	1,000,000	99,941,217.80	4.70
2	041461062	14晋焦煤CP002	700,000	70,186,609.58	3.30
3	041460111	14永泰能源CP002	630,000	63,001,614.21	2.96
4	041462028	14南山集CP002	500,000	50,497,914.41	2.37
5	041458048	14同盛CP001	500,000	50,402,314.28	2.37
6	011499028	14豫能源SCP001	500,000	50,058,548.39	2.35
7	041454063	14中铝CP001	500,000	50,008,707.74	2.35
8	041458083	14宝金属CP001	500,000	49,984,454.24	2.35
9	041461003	14金元CP001	400,000	40,236,296.78	1.89
10	041459068	14新投CP001	400,000	40,154,171.39	1.89

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.6“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	7次
报告期内偏离度的最高值	0.10%
报告期内偏离度的最低值	-0.35%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.11%

注:上表中“偏离情况”根据报告期内各工作日数据计算。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 本基金在报告期内不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮息债的摊余成本超过基金资产净值20%的情况。

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

5.8.4 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	14,519,467.99
4	应收申购款	2,814,765.52
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	17,334,233.51

5.8.5 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。

§6开放式基金份额变动

单位:份

项目	博时天天增利货币A	博时天天增利货币B
报告期期初基金份额总额	250,016,424.15	634,856,914.40
报告期期间基金总申购份额	925,023,962.57	3,782,205,196.17
减:报告期期间基金总赎回份额	845,931,206.12	2,618,101,672.51
报告期期末基金份额总额	329,109,180.60	1,798,960,437.70

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

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12月31日,博时基金公司共管理五十三只开放式基金,并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金,以及多个企业年金账户。博时基金资产管理净值总规模逾2363亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1124亿元人民币,累计分红超过638亿元人民币,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12月31日,博时主题行业股票基金今年以来净值增长率在365只标准型股票基金中排名第6,博时特许价值股票基金今年以来净值增长率在365只标准型股票基金中排名第12;博时精选股票基金在7只同类普通股票型基金中排名前1/2;博时裕富沪深300指数基金在同类150只标准指数股票型基金中排名前1/5,博时上证超大盘ETF及博时深证基本面200ETF在150只标准指数股票型基金中均排名前1/2;博时上证超级大盘ETF联接及博时深证基本面200ETF联接在同类45只产品中排名前1/2。混合基金中,博时裕益灵活配置混合在34只灵活配置型基金中排名前1/4,博时价值增长混合及博时价值增长贰号混合在同类29只产品中排名前1/2;博时平衡配置混合在同类16只产品中排名前1/2。

固定收益方面,博时信用债券(A/B类)今年以来收益率在93只同类普通债券型基金中排名第1;博时信用债券(C类)今年以来收益率在56只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(B类)今年以来收益率在41只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(A类)今年以来收益率在67只同类普通债券型基金中排名第2;博时转债增强债券(A类)今年以来收益率在13只可转换债券基金中排名第3;博时安丰18个月定期开放基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/3,博时信用债纯债债券基金、博时安心收益定期开放债券(A类)及博时月月薪定期支付债券基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/2;博时宏观回报债券(A/B类)及博时天颐债券(A类)在93只同类普通债券型基金中分别排名第7、第8;博时现金收益货币(A类)在78只同类货币市场基金中排名前1/2。

海外投资方面业绩方面,截至12月31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,博时抗通胀在8只QDII商品基金中排名第1。

2、客户服务

2014年四季度,博时基金共举办各类渠道培训活动219场,参加人数6102人。

3、其他大事件

2014年12月18日,博时国际获得和讯海外财经风云榜“2014年度最佳中资基金公司奖”;

2014年12月25日,博时基金获得金融界评选的“最佳品牌奖”。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

9.1.1中国证券监督管理委员会批准博时双月薪定期支付债券型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时天天增利货币市场基金基金合同》

9.1.3《博时天天增利货币市场基金托管协议》

9.1.4基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.1.5报告期内博时天天增利货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2存放地点:

基金管理人、基金托管人处

9.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,