博时天天增利货币市场基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

§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10月23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2015年7月1日起至9月30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	2,100,239,820.87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	123,535,767.61份 / 1,976,704,053.26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(2015年7月1日-2015年9月30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	914,511.26	16,844,557.09
2.本期利润	914,511.26	16,844,557.09
3.期末基金资产净值	123,535,767.61	1,976,704,053.26

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	0.7246%	0.0071%	0.3403%	0.0000%	0.3843%	0.0071%

注:基金收益分配是按日结转份额。

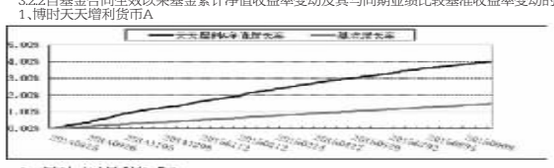
2、博时天天增利货币B:

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	0.7853%	0.0071%	0.3403%	0.0000%	0.4450%	0.0071%

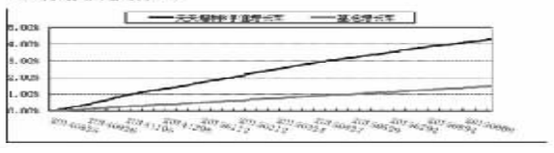
注:基金收益分配是按日结转份额。

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



§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		
魏棋	基金经理	2014-08-25	-	7	2004年起在厦门市商业银行任债券交易组主管,2008年加入博时基金管理有限公司,历任债券交易员、固定收益研究员、博时理财30天债券基金的基金经理。现任博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月新定期支付债券基金、博时安丰18个月定期开放债券(LOF)基金、博时双月新定期支付债券基金、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、博时现金收益货币基金、博时安盈债券基金、博时保证金宝货币ETF基金、博时证金宝货币基金的基金经理。

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、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,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报告期内基金投资策略和运作分析

2015年第三季度,受汇率波动和央行降准双重影响,货币市场流动性维持总体宽松充裕,回购利率低位稳定。银行间R001均值1.56%,R007均值2.48%。现券市场温和普涨,收益率曲线呈现出短端上行长端下行的平坦化修正走势,10Y-1Y期限利差缩小20BP至110BP。绝对收益追逐下叠加高收益资产缺乏导致中低评级信用债收益率本季下行幅度超过高评级,因此信用利差和评级利差进一步缩窄。1年期短融收益率分别为3.3%(AAA)、3.53%(AA+)、3.84%(AA)。

三季度,本基金秉承现金管理工具的流动性、安全性和收益性原则,以短期存款和短融为主。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为0.72%,B类基金份额净值增长率为0.79%,同期业绩基准增长率0.34%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

央行抑制投机加碾储加息暂缓,汇率贬值压力下降,缓解资金外流压力,信用需求疲软的情况下,有助于资金面内生性宽松。不过央行在近期开始净回笼资金,显示一旦金融风险下降后,货币政策并没有大水漫灌的倾向。从这个角度而言,当总需求超预期下行和金融风险上升时,央行一定会加大宽松力度以维持流动性稳定,但一旦恐慌情绪过后,货币政策可能还是会以调结构为取向。目前市场的主要驱动力依然是股市财富效应弱化、风险偏好下降带来的资金回流支撑。预计央行依然会“灵活运用多种货币政策工具保持适度流动性”,引导货币利率低位稳定,宽松周期仍在持续。

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适度的组合期限。未来一段时间,继续以存款为主要投资工具,标配短期融资券。

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	固定收益投资	1,150,489,715.06	50.46
	其中:债券	1,150,489,715.06	50.46
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	90,000,575.00	3.95
	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	917,054,134.88	40.22
4	其他资产	122,638,298.97	5.38
5	合计	2,280,182,723.91	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	5.57	
	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	178,605,532.09	8.50
	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	117
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	90

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
1	2015-08-26	123	控制流动性风险,当日存款到期未续做	3个交易日
2	2015-08-27	122	控制流动性风险,当日存款到期未续做	2个交易日
3	2015-08-28	121	控制流动性风险,当日存款到期未续做	1个交易日
4	2015-09-08	125	控制流动性风险,当日存款到期未续做	4个交易日
5	2015-09-09	125	控制流动性风险,当日存款到期未续做	3个交易日
6	2015-09-10	121	控制流动性风险,当日存款到期未续做	2个交易日
7	2015-09-11	121	控制流动性风险,当日存款到期未续做	1个交易日
8	2015-09-17	125	控制流动性风险,当日存款到期未续做	3个交易日
9	2015-09-18	124	控制流动性风险,当日存款到期未续做	2个交易日
10	2015-09-21	121	控制流动性风险,当日存款到期未续做	1个交易日
11	2015-09-24	121	控制流动性风险,当日存款到期未续做	3个交易日
12	2015-09-25	123	控制流动性风险,当日存款到期未续做	2个交易日
13	2015-09-28	121	控制流动性风险,当日存款到期未续做	1个交易日

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	43.67	8.50
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	12.96	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	0.95	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	7.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	38.10	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		102.73	8.50

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	110,106,603.59	5.24
	其中:政策性金融债	110,106,603.59	5.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,040,384,111.47	49.54
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,150,489,715.06	54.78
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

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	011500253	15首创SCP001	1,000,000	100,034,112.46	4.76
2	041572012	15宁夏国资CP001	1,000,000	99,961,851.03	4.76
3	011574005	15陕煤化SCP005	800,000	79,988,954.13	3.81
4	011599503	15潞产业SCP004	800,000	79,964,282.06	3.81
5	041461062	14晋焦煤CP002	600,000	60,018,389.04	2.86
6	041460111	14永泰能源CP002	600,000	60,000,213.25	2.86
7	041577004	15华能新能CP003	600,000	59,975,965.05	2.86
8	041562042	15省山焦CP001	600,000	59,975,468.34	2.86
9	150413	15农发13	600,000	59,973,966.64	2.86
10	041554032	15三化CP001	500,000	50,152,368.68	2.39

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	3次
报告期内偏离度的最高值	0.30%
报告期内偏离度的最低值	0.10%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.16%

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	16,507,651.58
4	应收申购款	106,130,647.39
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	122,638,298.97

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
本报告期期初基金份额总额	76,058,619.11	1,103,318,756.52
报告期基金总申购份额	279,658,872.91	4,123,694,739.69
报告期基金总赎回份额	232,181,724.41	3,250,309,442.95
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期末基金份额总额	123,535,767.61	1,976,704,053.26

§7 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2015年9月30日,博时基金公司共管理七十一只开放式基金,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3010.43亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1,427.53亿元人民币,累计分红超过670.72亿元人民币,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,指数股票型基金中,截至9月30日,博时裕富沪深300基金及博时深证基本面200ETF今年以来净值增长率在172只标准型股票基金中分别排名前1/2;混合基金-偏股型基金中,博时创业成长混合基金、博时卓越品牌混合(LOF)、博时医疗保健行业混合基金今年以来净值增长率在360只混合偏股基金中排名前1/2;混合基金-灵活配置型基金中,博时灵活配置混合基金今年以来收益率在103只同类基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时安丰18个月定期开放债券LOF今年以来在15只同类封闭普通股票型基金中排名第一。在长期标准债券基金A类中,博时双月薪定期支付债券今年以来收益率在同类68只排名前1/10,博时岁岁增利一年定期开放债券、博时月月薪定期支付债券排名前1/3,博时信用债纯债A、博时安心收益定期开放债券A以及博时优势收益信用债债券基金排名前1/2;在长期标准债券基金B/C类中,博时安心收益定期开放债券C类今年以来收益率在同类47只中排名前1/3;普通债券型基金中,博时稳定价值债券A类和B类在同类88只一级A类和51只一级B类中,今年以来收益率都排名前1/5;可转债基金中,博时转债增强A今年以来收益率在同类15只排名前1/2;指数债券型中,博时上证企债30ETF在同类18只中排名前1/3;货币市场基金里,博时现金宝货币A类在同类150只中排名前1/2。

2、其他大事件

2015年8月3日,博时基金经理过钧和张溪冈,荣获证券时报颁发的英华奖;同时,过钧获得证券时报评选的三年期和五年期固定收益类-最佳基金经理,张溪冈获得证券时报评选的三年期海外投资-最佳基金经理。

§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天天增利货币市场基金设立的文件

9.1.2《博时天天增利货币市场基金合同》

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博时天天增利货币市场基金各年度审计报告正本

9.1.6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、基金托管人住所

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
二〇一五年十月二十六日

博时天颐债券型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时天颐债券	
基金主代码	050023	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年2月29日	
报告期末基金份额总额	49,179,628.61份	
投资目标	在谨慎投资的前提下,本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	在投资范围的约束下,通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法,在固定收益类、权益类和流动性资产之间进行动态调整。固定收益类资产主要运用期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、期权策略等,在控制综合风险的前提下,最大化预期收益。权益类资产投资主要选择带有政府背景优势、技术壁垒优势、市场与品牌壁垒优势特征,具备持续竞争力和成长力的企业作为投资标的。同时,持有部分流动性资产,应对流动性需求,并提供市场下跌时的净值保护。在谨慎投资的前提下,本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益,同时强调稳健的投资风格,争取实现基金资产长期保值增值的目标,从而在一定程度上满足投资者未来养老费用的支出需求。	
业绩比较基准	三年期定期存款利率(税后)+1%。存续期间内,3年期定期存款利率随中国人民银行公布的利率水平的调整而调整。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于中低风险/收益的产品。	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博时天颐债券A类	博时天颐债券C类
下属分级基金的交易代码	050023	050123
报告期末下属分级基金的份额总额	18,859,363.77份	30,340,264.84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(2015年7月1日-2015年9月30日)	
	博时天颐债券A类	博时天颐债券C类
1.本期已实现收益	-2,621,032.90	-4,062,998.90
2.本期利润	-3,329,385.61	-5,047,127.07
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1736	-0.1699
4.期末基金资产净值	19,369,278.88	30,679,347.69
5.期末基金份额净值	1.028	1.011

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,计入费用后投资人的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

1、博时天颐债券 A类:

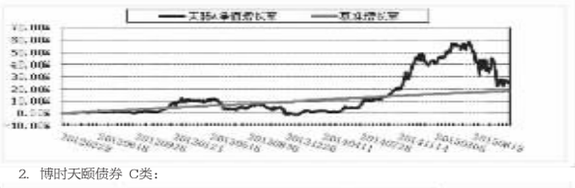
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-14.26%	2.13%	1.05%	0.01%	-15.31%	2.12%

2、博时天颐债券 C类:

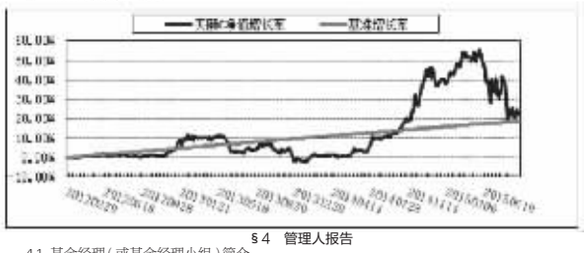
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-14.32%	2.14%	1.05%	0.01%	-15.37%	2.13%

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

1. 博时天颐债券 A类:



2. 博时天颐债券 C类:



§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		
杨永光	固定收益总部公募基金组投资副总监/基金经理	2012-02-29	-	135	1993年至1997年先后在桂林电器科学研究所、深圳迈瑞生物医疗电子股份公司工作。1997年起在国海证券历任债券研究员、债券投资经理助理、高级投资经理、投资主办人,2011年加入博时基金管理有限公司,曾任博时稳定价值债券基金的基金经理。现任固定收益总部公募基金组投资副总监兼博时天颐债券基金、上证企债30ETF基金、博时优势收益信用债债券基金、博时招财一号保本基金、博时新机遇混合基金的基金经理

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、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 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报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度,国内地产投资未见起色,经济增长弱于预期,企业经营效益加速恶化。券商两融市场及场外配资的清理,加速了权益市场的调整,转债市场也遭受重创。同时,IPO的暂停使得大量的打新资金涌入债券市场,债券市场出现了较大的上涨行情,信用债上涨幅度相对较大,与利率债的利差进一步缩小。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金A类基金份额净值为1.028元,份额累计净值为1.281元;C类基金份额净值为1.011元,份额累计净值为1.254元。报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为-14.26%,C类基金份额净值增长率为-14.32%,同期业绩基准增长率1.05%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下个季度,由于经济增长速度已接近政府调控的目标下限,国内基建投资有可能面临提速,经济增长有可能出现短暂的企稳。同时,权益市场大规模资金分流行为已大体结束,债券市场的上涨速率将有所减缓。此外,美国在未来可能的加息对国内债券市场来说始终是一个利空。总之,债券市场在四季度将会遇到相对三季度来说更大的困难,总体上为震荡行情的概率较大,债券收益率水平上下的幅度均不大。操作上,适度减小债券组合久期,加强对债券发行主体信用风险控制;保持对转债的关注,积极参与转债的波段操作。

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	9,437,010.84	10.77
	其中:股票	9,437,010.84	10.77
2	固定收益投资	68,530,154.32	78.18
	其中:债券	68,530,154.32	78.18
	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	7,911,986.79	9.03
7	其他各项资产	1,779,802.59	2.03
8	合计	87,658,954.54	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,794,210.84	9.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,957,200.00	3.91
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,242,000.00	2.48
J	金融业	1,443,600.00	2.88
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	9,437,010.84	18.86

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	000728	国元证券	90,000	1,443,600.00	2.88
2	300195	长荣股份	76,000	1,301,880.00	2.60
3	002081	金螳螂	96,000	1,262,400.00	2.52
4	000860	顺鑫农业	80,147	1,259,910.84	2.52
5	002410	广联达	90,000	1,242,000.00	2.48
6	600261	阳光照明	180,000	1,186,200.00	2.37
7	002501	利源精制	106,000	1,046,220.00	2.09
8	600820	隧道股份	60,000	694,800.00	1.39

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	6,031,161.60	12.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	54,357,111.60	108.61
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	8,141,881.12	16.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	68,530,154.32	136.93

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	132001	14宝钢EB	127,100	15,468,070.00	30.91
2	124977	14天瑞03	69,960	7,086,948.00	14.16
3	124161	13瑞水泥	64,990	6,605,583.60	13.20
4	112235	15福星01	60,000	6,456,600.00	12.90
5	010303	03国债(3)	59,520	6,031,161.60	12.05

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投资。

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有股指期货。

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投资国债期货交易。

5.11投资组合报告附注

5.11.1报告期内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。

5.11.2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	100,249.29
2	应收证券清算款	86,667.42
3	应收股利	-
4	应收利息	1,446,280.23
5	应收申购款	146,605.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,779,802.59

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	113008	电气转债	4,983,700.00	9.96
2	128009	歌尔转债	3,158,181.12	6.31

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金期末前十名股票中不存流通受限的情况。

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

项目	博时天颐债券A类	博时天颐债券C类
本报告期期初基金份额总额	20,228,614.89	34,018,098.74
报告期基金总申购份额	1,694,170.75	7,336,643.49
减:报告期基金总赎回份额	3,083,421.87	11,014,477.39
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	18,839,363.77	30,340,264.84

§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2015年9月30日,博时基金公司共管理七十一只开放式基金,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3010.43亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1,427.53亿元人民币,累计分红超过670.72亿元人民币,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,指数股票型基金中,截至9月30日,博时裕富沪深300基金及博时深证基本面200ETF今年以来净值增长率在172只标准型股票基金中分别排名前1/2;混合基金-偏股型基金中,博时创业成长混合基金、博时卓越品牌混合(LOF)、博时医疗保健行业混合基金今年以来净值增长率在360只混合偏股基金中排名前1/2;混合基金-灵活配置型基金中,博时灵活配置混合基金今年以来收益率在103只同类基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时安丰18个月定期开放债券LOF今年以来在15只同类封闭普通股票型基金中排名第一。在长期标准债券基金A类中,博时双月薪定期支付债券今年以来收益率在同类68只排名前1/10,博时岁岁增利一年定期开放债券、博时月月薪定期支付债券排名前1/3,博时信用债纯债A、博时安心收益定期开放债券A以及博时优势收益信用债债券基金排名前1/2;在长期标准债券基金B/C类中,博时安心收益定期开放债券C类今年以来收益率在同类47只中排名前1/3;普通债券型基金中,博时稳定价值债券A类和B类在同类88只一级A类和51只一级B类中,今年以来收益率都排名前1/5;可转债基金中,博时转债增强A今年以来收益率在同类15只排名前1/2;指数债券型中,博时上证企债30ETF在同类18只中排名前1/3;货币市场基金里,博时现金宝货币A类在同类150只中排名前1/2。

2、其他大事件

2015年8月3日,博时基金经理过钧和张溪冈,荣获证券时报颁发的英华奖;同时,过钧获得证券时报评选的三年期和五年期固定收益类-最佳基金经理,张溪冈获得证券时报评选的三年期海外投资-最佳基金经理。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

9.1.1中国证监会批准博时天颐债券型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时天颐债券型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时天颐债券型证券投资基金托管协议》

9.1.4基金管理人业务