

## 博时天天增利货币市场基金

## [2015] 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:中国银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一六年一月二十日  
§ 1 重要提示

基金管理人的董事局及董事会声明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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人和报告编制人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。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告期自2015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 000074

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2014年4月26日

报告期末基金份额总额 2,346,097,000.14份

投资目标 在保持资产流动性的同时获得高于银行存款的稳定收益。

投资策略 本基金将通过严格的投资管理与恰当的资产配置，在充分考虑安全性、流动性和收益率的基础上为投资者提供稳健的回报。

业绩比较基准 七天通知存款利率(税后)

风险收益特征 属于货币市场基金，是最低风险品种，本基金的预期风险和预期收益均低于股票型基金、债券型基金、混合型基金。

基金管理人 调整后的资产净值收入扣除相关费用后的余额，本公司

为定期报告期间实现的公允价值变动收益扣除相关费用后的余额，本公司

为定期报告期间实现的公允价值变动收益。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)

博时天天增利货币A 913,790,000 16,093,276.00

博时天天增利货币B 913,790,000 16,093,276.00

3月末基金资产净值 119,614,767.29份 2,726,582,332.41份

§ 3.1 主要财务指标和基金净值表现

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，本期为定期报告期间实现的公允价值变动收益扣除相关费用后的余额。

3.2.1 本期报告期基金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(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.720% 0.001% 0.340% 0.0000% 0.303% 0.0001%

2.博时天天增利货币B:

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.790% 0.001% 0.340% 0.0000% 0.444% 0.0001%

注:基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 基金本期生息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:

上表中,基金的本期累计净值收益率和净值。

5.6.5 报告期内按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 摆余成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 - -

2 风险厌恶债券 - -

3 金融债券 140,179,211.22 4.00

其中:政策性金融债 140,179,211.22 4.00

4 企业债券 - -

5 中期票据 - -

6 同业存单 329,338,024.13 11.67

7 其他 - -

8 合计 1,329,545,966.00 46.71

9 债券的公允价值变动损益 - -

注:上表中,债券的本期公允价值变动损益和价差。

5.6.6 报告期内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 证券名称 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 - -

2 风险厌恶债券 - -

3 金融债券 100,031,033.33 30.22

4 中期票据 - -

5 同业存单 329,338,024.13 11.67

6 其他 - -

7 合计 1,329,545,966.00 46.71

9 债券的公允价值变动损益 - -

注:上表中,债券的本期公允价值变动损益和价差。

5.6.7 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名贵金属投资明细

序号 证券名称 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 金 - -

2 银 - -

3 其他 - -

4 合计 - -

注:上表中,贵金属的本期公允价值变动损益和价差。

5.6.8 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

序号 证券名称 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 金 - -

2 银 - -

3 其他 - -

4 合计 - -

注:上表中,股票的本期公允价值变动损益和价差。

5.6.9 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证及股权投资明细

序号 证券名称 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 金 - -

2 银 - -

3 其他 - -

4 合计 - -

注:上表中,权证及股权的本期公允价值变动损益和价差。

5.6.10 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名的其他投资品种情况

序号 证券名称 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 金 - -

2 银 - -

3 其他 - -

4 合计 - -

注:上表中,其他投资品种的本期公允价值变动损益和价差。

5.7 报告期内基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 固定收益投资 1,329,545,966.00 46.69

2 存款类资产 - -

3 买入返售金融资产 100,031,033.33 3.61

4 其他资产 68,070.67 0.00

5 应收利息 - -

6 应付费用 - -

7 其他 - -

8 合计 1,329,684,033.33 46.70

注:报告期末按公允价值占基金资产净值的比例为报告期末每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

5.8 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

报告期初基金份额总额 123,158,707.00 1,704,263.26

报告期期间申购净额 4,713,006,000.00

报告期期间赎回净额 3,963,177,011.40

报告期末基金份额总额 1,329,545,966.00 46.70

注:报告期末按公允价值占基金资产净值的比例为报告期末每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

5.9 备查文件目录

1.中国证监会批准基金设立的文件;

2.基金章程;

3.基金托管协议;

4.基金募集申请报告;

5.基金上市公告书;

6.基金宣传推介材料;

7.基金临时公告及定期报告;

8.基金份额净值公告、基金定期报告及相关信息披露文件;

9.基金半年度报告与基金年度报告;

10.基金季度报告;

11.基金半年度报告提示性公告与基金年度报告提示性公告;

12.基金上市公告书提示性公告;

13.基金临时公告提示性公告;

14.基金销售机构信息、费率等与基金相关的各项公告;

15.基金份额持有人名册;

16.中国证监会要求的其他文件。

5.10 备查文件说明

本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规的规定，对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。

基金托管人和报告编制人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。

基金管理人以诚信原则、勤勉尽责的原则履行基金合同规定的义务，坚持“基金管理规范化、运作公开化、服务专业化”的原则，为基金份额持有人谋取利益。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)

1.本期已实现收益 16,544,702,907.00

2.本期利润 16,544,702,907.00

3.期末基金资产净值 20,247,022,900.00

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，本期为定期报告期间实现的公允价值变动收益扣除相关费用后的余额。

3.2.1 本期报告期基金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(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.672% 0.002% 0.094% 0.0000% 0.563% 0.0032%

2.博时天天增利货币B:

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.672% 0.002% 0.094% 0.0000% 0.563% 0.0032%

注:基金净值收益率是指扣除管理费、托管费后的净值增长率。

3.2.2 本期基金生息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</