

# 博时天天增利货币市场基金

## 2015 年半年度报告摘要

2015 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年八月二十七日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 26 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 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	博时天天增利货币	
基金主代码	000734	
交易代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	1, 179, 377, 375. 63 份	
基金合同存续期	不定期	
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	76, 058, 619. 11 份	1, 103, 318, 756. 52 份

### 2.2 基金产品说明

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。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	王永民
	联系电话	0755-83169999	010-66594896
	电子邮箱	service@bosera.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105568	95566
传真		0755-83195140	010-66594855

### 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	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

## § 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 (2015 年 1 月 1 日-2015 年 6 月 30 日)	
	博时天天增利货币 A	博时天天增利货币 B
本期已实现收益	2,266,808.51	17,238,458.08
本期利润	2,266,808.51	17,238,458.08
本期净值收益率	1.7577%	1.8800%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2015 年 6 月 30 日)	
	博时天天增利货币 A	博时天天增利货币 B
期末基金资产净值	76,058,619.11	1,103,318,756.52
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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 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	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	0.2419%	0.0034%	0.1110%	0.0000%	0.1309%	0.0034%
过去三个月	0.8121%	0.0027%	0.3366%	0.0000%	0.4755%	0.0027%
过去六个月	1.7577%	0.0022%	0.6695%	0.0000%	1.0882%	0.0022%
自基金合同生效起至今	3.2863%	0.0049%	1.1466%	0.0000%	2.1397%	0.0049%

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	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	0.2616%	0.0034%	0.1110%	0.0000%	0.1506%	0.0034%
过去三个月	0.8726%	0.0027%	0.3366%	0.0000%	0.5360%	0.0027%
过去六个月	1.8800%	0.0022%	0.6695%	0.0000%	1.2105%	0.0022%
自基金合同生效起至今	3.4983%	0.0049%	1.1466%	0.0000%	2.3517%	0.0049%

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 2015 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理七十只开放式基金，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 3027.86 亿元人民币，其中公募基金资产规模逾 1317.35 亿元人民币，累计分红超过 664.83 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，博时创业成长

股票基金及博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在 379 只标准型股票基金中分别排名前 1/3 和前 1/2；博时深证基本面 200ETF 及联接基金今年以来的净值增长率在 175 只指数股票型基金-标准指数股票基金及 46 只 ETF 联接基金中分别排名前 1/2 和前 1/3；混合基金-偏股型基金中，博时精选股票基金今年以来的收益率在同类型 36 只产品中排名前 1/3；混合基金-灵活配置型基金中，博时裕隆灵活配置混合及博时裕益灵活配置混合基金今年以来的净值增长率在 126 只同类型基金中分别排名前 1/3 和前 1/2。

固定收益方面，博时安丰 18 个月定期开放债券基金、博时优势收益信用债券、博时信用债纯债券今年以来收益率在 71 只同类长期标准债券型基金中分别排名前 1/10、前 1/2 和前 1/2；博时上证企债 30ETF 今年以来的收益率在 18 只指数债券型基金-指数债券型基金 (A 类) 排名前 1/3。

## 2、其他大事件

2015 年 1 月 7 日，博时基金在 2014 年信息时报金狮奖—金融行业风云榜的评选中获得年度最佳基金公司大奖。

2015 年 1 月 15 日，在和讯网主办的第十二届中国财经风云榜评选中，博时基金获评第十二届中国财经风云榜“年度十大品牌基金公司”奖。

2015 年 1 月 18 日，博时基金（香港）在和讯财经风云榜海外评选中荣获“最佳中资基金公司”奖。

2015 年 1 月 21 日，在《华夏时报》第八届投资者年会暨金蝉奖评选中，博时转债增强荣获第八届金蝉奖“2014 最佳年度债基品牌奖”。

2015 年 3 月 28 日，在第十二届中国基金业金牛奖评选中，博时主题行业（LOF）基金、博时信用债券基金分别获得“2014 年度开放式股票型金牛基金”奖、“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2015 年 3 月 28 日，在中金在线主办的“2014 年度财经排行榜”评选中，邓欣雨获评“2014 年度中金在线财经排行榜最佳基金经理”。

2015 年 4 月 22 日，由上海证券报社主办的第十二届中国“金基金”奖的评选揭晓，博时主题行业股票证券投资基金 (LOF) 获得 5 年期股票型金基金奖。

### 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	证券从业	说明
----	----	-----------	------	----

		(助理) 期限		年限	
		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	2014-08-25	2015-06-09	11.5	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、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、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、固定收益总部现金管理组投资总监。
魏帧	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。现任博时理财 30 天债券基金兼博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月薪定期支付债券基金、博时安丰 18 个月定期开放债券（LOF）基金、博时双月薪定期支付债券基金、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、博时保证金货币 ETF 基金、博时证金宝货币基金的基金经理。

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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，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 管理人对报告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的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年，基本面趋于企稳、资金面由紧转松，4 月份开始货币市场利率不断下行至低位，债券收益率曲线呈现短端下行幅度大于长端的陡峭化特征。R001 收于 2.31%，R007 收于 3.41%，1 年 AAA、AA+、AA 短融收益率分别为 3.43%、3.91%、4.35%。上半年，本基金秉承现金管理工具的流动性和安全性原则，以滚动投放存款为主，同时增配短融增强收益。

##### 4.4.2 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 1.76%，B 类基金份额净值增长率为 1.88%，同期业绩基准增长率 0.67%。

#### 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，周期性的经济增长和通胀或许并不是债市最重要的因素，资产负债表重塑，稳定资产价格、降低债务风险，以及与之对应的资金面宽松，才是最关键的变量。这实质上意味着，对债市而言，资产负债表修复和慢性去杠杆却使得债券的慢牛能够维持较长时间。基本面决定利率中枢、货币政策与投资节奏决定波段和波动区间，短端收益率有进一步下行的空间，中长端信用债收益率的下行空间也将会被打开。

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，我们将保持存款的较高比例，同时不断加大短期融资券的投资力度。

#### 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、风险管理部负责人、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值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 A 类本报告期内向份额持有人分配利润 2,266,808.51 元；本基金 B 类本报告期内向份额持有人分配利润 17,238,458.08 元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对博时天天增利货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

# § 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：博时天天增利货币市场基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	447,9	480,6
结算备付金		
存出保证金		
交易性金融资产	643,9	904
其中：股票投资		
基金投资		
债券投资	643,9	904
资产支持证券投资		
贵金属投资		
衍生金融资产		
买入返售金融资产	145,6	835,3
应收证券清算款		
应收利息	12,8	14
应收股利		
应收申购款	2,7	2,8
递延所得税资产		
其他资产		
<b>资产总计</b>	<b>1,253,1</b>	<b>2,238</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

	2015 年 6 月 30 日	2014 年 12 月 31 日
<b>负债：</b>		
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	73,0	108,9
应付证券清算款		
应付赎回款		
应付管理人报酬	3	4
应付托管费		1
应付销售服务费		
应付交易费用		
应交税费		
应付利息		
应付利润		2
递延所得税负债		
其他负债	1	
<b>负债合计</b>	<b>73,7</b>	<b>110,0</b>
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,179,3	2,128,0
未分配利润		
<b>所有者权益合计</b>	<b>1,179,3</b>	<b>2,128,0</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>1,253,1</b>	<b>2,238,1</b>

注：本基金合同于 2014 年 8 月 25 日生效。报告截止日 2015 年 06 月 30 日，基金份额总额

1,179,377,375.63 份。其中 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 76,058,619.11 份；B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,103,318,756.52 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时天天增利货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	<b>23,129,285.64</b>
1. 利息收入	22,529,831.31
其中：存款利息收入	10,783,694.56
债券利息收入	9,015,090.19
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	2,731,046.56
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	599,454.33
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	599,454.33

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）	-
<b>减：二、费用</b>	<b>3,624,019.05</b>
1. 管理人报酬	1,744,412.73
2. 托管费	528,609.93
3. 销售服务费	203,975.00
4. 交易费用	-
5. 利息支出	919,520.24
其中：卖出回购金融资产支出	919,520.24
6. 其他费用	227,501.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>19,505,266.59</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>19,505,266.59</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时天天增利货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	2,128,069,618.30	-	2,128,069,618.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,505,266.59	19,505,266.59
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）	-948,692,242.67	-	-948,692,242.67
其中：1. 基金申购款	2,672,023,129.34	-	2,672,023,129.34
2. 基金赎回款	-3,620,715,372.01	-	-3,620,715,372.01
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）	-	-19,505,266.59	-19,505,266.59
五、期末所有者权益（基金净值）	1,179,377,375.63	-	1,179,377,375.63

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：

基金管理人负责人：江向阳

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

除以下会计估计变更外，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：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

### 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》，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，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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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

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
	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,744,412.73
其中：支付销售机构的客户维护费	219,398.85

注：支付基金管理人博时基金的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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 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
	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	528,609.93

注：支付基金托管人中国银行的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：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 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		
	2015年1月1日至2015年6月30日		
	博时天天增利货币 A 类	博时天天增利货币 B 类	合计
博时基金	10,795.14	41,241.42	52,036.56
中国银行	121,392.46	3,093.28	124,485.74
合计	132,187.60	44,334.70	176,522.30

注：支付基金销售机构的销售服务费 A 类按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，B 类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：

A 类日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数

B 类日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.01% / 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期					
	2015年1月1日至2015年6月30日					
	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
中国银行	-	29,874,626.17	-	-	-	-

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

无。

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

无。

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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	3,082,276.78	15,298.16
中国银行-定期存款	-	-

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5 期末（2015 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 73,019,763.49 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
011537003	15 中建材 SCP003	2015-07-01	100.72	600,000.00	60,432,000.00
041460106	14 海沧投资 CP002	2015-07-01	100.81	178,000.00	17,944,180.00
合计				778,000.00	78,376,180.00

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	643,900,717.22	51.38
	其中：债券	643,900,717.22	51.38
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	145,600,858.40	11.62
	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	447,982,276.78	35.75
4	其他各项资产	15,665,424.96	1.25
5	合计	1,253,149,277.36	100.00

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	6.87	
	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	73,019,763.49	6.19
	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%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 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	93
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	131
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	72

#### 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	2015-02-03	122	巨额赎回规模缩减导致被动超标	2 个交易日
2	2015-02-04	121	巨额赎回规模缩减导致被动超标	2 个交易日
3	2015-02-06	125	巨额赎回规模缩减导致被动超标	1 个交易日
4	2015-02-10	125	巨额赎回规模缩减导致被动超标	1 个交易日
5	2015-05-29	131	为控制流动性风险，当日存款到期未续做	5 个交易日
6	2015-06-01	128	组合未进行交易，市场被动波动导致	4 个交易日



7	2015-06-02	127	组合未进行交易, 市场被动波动导致	3 个交易日
8	2015-06-03	126	组合未进行交易, 市场被动波动导致	2 个交易日
9	2015-06-04	125	组合未进行交易, 市场被动波动导致	1 个交易日

### 7.3.2 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	45.83	6.19
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	10.18	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	5.97	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	25.70	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	16.99	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	104.67	6.19

### 7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位: 人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,262,310.59	5.96
	其中: 政策性金融债	70,262,310.59	5.96
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	573,638,406.63	48.64
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	643,900,717.22	54.60
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。

### 7.5 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

金额单位: 人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	041460111	14 永泰能源 CP002	630,000	63,000,698.47	5.34
2	041461062	14 晋焦煤 CP002	600,000	60,066,464.39	5.09
3	011537003	15 中建材 SCP003	600,000	59,914,441.60	5.08
4	041563008	15 首钢 CP002	500,000	50,186,485.66	4.26
5	041564038	15 中盐 CP002	500,000	50,016,211.32	4.24
6	041459068	14 新投 CP001	400,000	40,060,376.69	3.40

7	071504006	15 广发 CP006	400,000	39,995,436.32	3.39
8	041454054	14 方洋 CP002	300,000	30,207,373.60	2.56
9	140223	14 国开 23	300,000	30,132,549.64	2.55
10	011599201	15 厦翔业 SCP003	300,000	30,033,289.74	2.55

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

## 7.6 “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	23 次
报告期内偏离度的最高值	0.40%
报告期内偏离度的最低值	-0.16%
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”根据报告期内各交易日数据计算。

## 7.7 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。

## 7.8 投资组合报告附注

### 7.8.1 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，基金份额净值始终保持 1.00 元。

7.8.2 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。

7.8.3 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。

### 7.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	12,897,590.58
4	应收申购款	2,767,834.38
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	15,665,424.96

### 7.8.5 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时天天增利货币 A	1,143	66,542.97	11,042,151.70	14.52%	65,016,467.41	85.48%
博时天天增利货币 B	18	61,295,486.47	1,061,436,654.57	96.20%	41,882,101.95	3.80%
合计	1,161	1,015,828.92	1,072,478,806.27	90.94%	106,898,569.36	9.06%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	博时天天增利货币 A	-	-
	博时天天增利货币 B	-	-
	合计	-	-

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时天天增利货币 A	-
	博时天天增利货币 B	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时天天增利货币 A	-
	博时天天增利货币 B	-
	合计	-

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；  
 2、本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 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
基金合同生效日(2014年8月25日)基金份额总额	884,294,438.29	198,758,696.94
本报告期期初基金份额总额	329,109,180.60	1,798,960,437.70
本报告期基金总申购份额	551,351,116.79	2,120,672,012.55
减：本报告期基金总赎回份额	804,401,678.28	2,816,313,693.73

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	76,058,619.11	1,103,318,756.52

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人于 2015 年 4 月 13 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，吴姚东不再担任博时基金管理有限公司总经理职务，由王德英代任总经理职务。2、基金管理人于 2015 年 6 月 20 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，徐卫担任博时基金管理有限公司副总经理职务。3、基金管理人于 2015 年 7 月 10 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，江向阳担任博时基金管理有限公司总经理职务。4、基金管理人于 2015 年 8 月 8 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张光华任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人，洪小源不再任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人。

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2015 年 2 月，我司收到《深圳证监局关于对博时基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，要求公司对后台权限设置等问题进行改正，我司立即进行了改正并已经完成了验收。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	-	-	-	-	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	5,000,000.00	100.00%	-	-

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

本基金在本报告期内不存在偏离度绝对值在 0.5%（含）以上的情况。

博时基金管理有限公司  
二〇一五年八月二十七日