

# 博时天天增利货币市场基金

## 2016 年第 3 季度报告

### 2016 年 9 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：二〇一六年十月二十四日

## § 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 2016 年 10 月 21 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 2016 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	3,520,046,598.60 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	113,283,950.34 份	3,406,762,648.26 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(2016年7月1日-2016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	739,378.02	22,765,647.79
2. 本期利润	739,378.02	22,765,647.79
3. 期末基金资产净值	113,283,950.34	3,406,762,648.26

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	0.5685%	0.0022%	0.3393%	0.0000%	0.2292%	0.0022%

注：基金收益分配是按日结转份额。

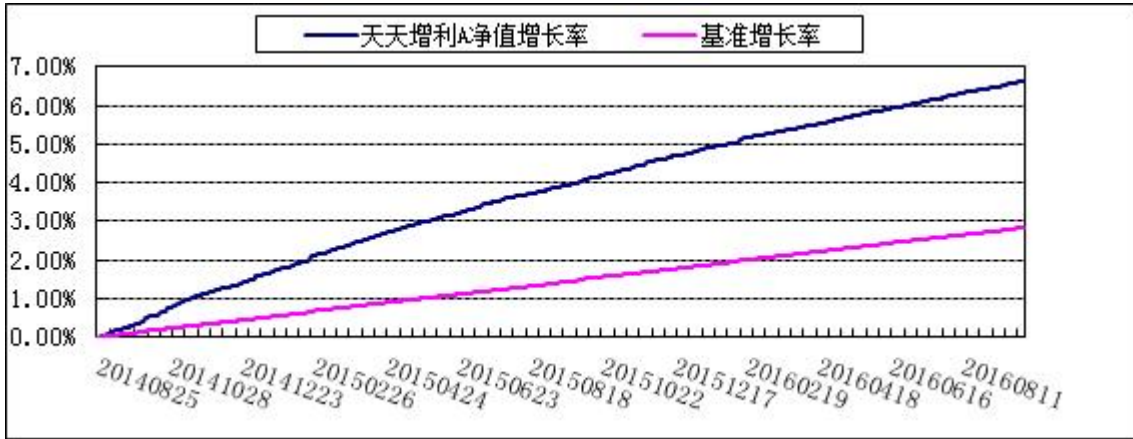
###### 2、博时天天增利货币 B:

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	0.6293%	0.0022%	0.3393%	0.0000%	0.2900%	0.0022%

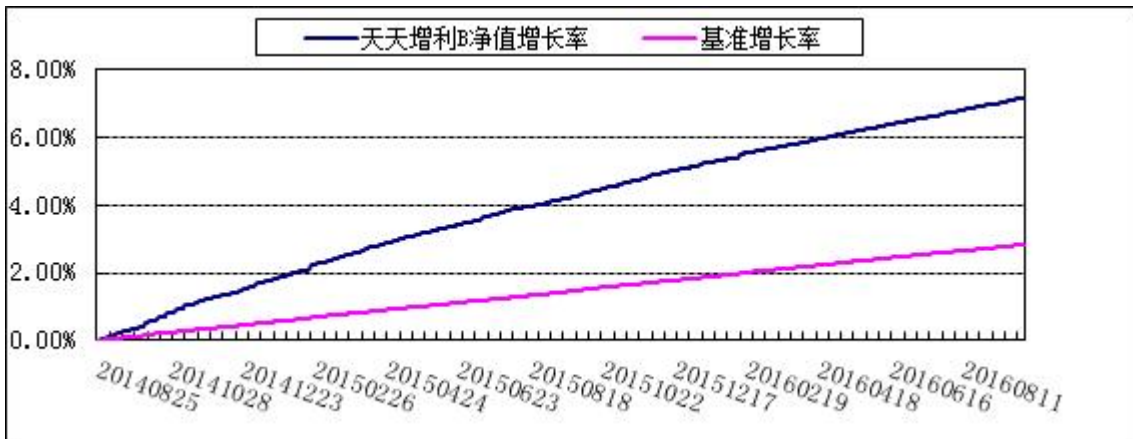
注：基金收益分配是按日结转份额。

##### 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		
魏桢	固定收益总部 现金管理组投资 投资副总监/基金 经理	2014-08-25	-	8.2	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、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、博时双月薪定期支付债券基金的基金经理。现任固定收益总部现金管理组投资副总监兼博时安丰18个月定期开放债券（LOF）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、博时外服货币基金、博时安荣 18 个月定期开放债券基金、博时裕创纯债债券型证券投资基金、博时安润 18 个月定开债基金、博时裕盛纯债债券基金、博时产业债纯债基金、博时安仁一年定开债基金、博时合利货币基金、博时安恒 18 个月定开债基金的基金经理。
--	--	--	--	--

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、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

2016 年三季度政策基调仍侧重于供给侧改革，内需和外需的低迷引发投资活动低位运行，使经济增速延续放缓态势。经济金融数据表现偏弱，工业增加值同比徘徊在 6.0%-6.3% 低位区间内，固定资产投资同比维持在 8.1% 的低位附近，CPI 同比由 6 月份

的 1.9% 回落至 8 月份的 1.30%，7 月新增人民币贷款 4550 亿创下近 2 年新低。基本面因素整体有利于债券市场，加上资产配置压力的配合，利率品种总体走出一波上涨行情，其中超长端利率品种表现最好。以 30 年期国债为例，从季初 3.52% 下行 33bps 至季末 3.19%。信用品种得益于配置资金的快速增长，信用利差持续被压缩至历史低位区间。央行继续执行中性偏宽松的货币政策，通过公开市场操作主动维持资金面的稳定，并意图以“利率走廊”策略来锚定短端利率的上下限。三季度流动性呈现总体宽松、阶段性紧张的局面，回购利率窄幅波动，银行间 R001、R007 均值分别为 2.10%、2.49%。三季度下旬资金面趋紧但整体依然可控，MPA 考核因素以及外汇占款连续下降引发的累积效应是主要原因。

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，以短期存款和存单配置为主。操作上把握住资金紧张的关键时点适当拉长组合平均剩余期限，配置高收益资产，提高组合收益率。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.5685%，B 类基金份额净值增长率为 0.6293%，同期业绩基准增长率 0.3393%。

#### 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	2,581,286,608.09	73.28
	其中：债券	2,488,436,608.09	70.64
	资产支持证券	92,850,000.00	2.64
2	买入返售金融资产	237,000,755.50	6.73
	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	690,712,387.69	19.61
4	其他资产	13,464,148.94	0.38
5	合计	3,522,463,900.22	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	2.42	
	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

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	78
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	81
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

### 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。

### 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	25.01	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	29.92	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	15.42	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	8.24	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	21.10	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.69	-



#### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 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 240 天

#### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（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	250,108,587.82	7.11
	其中：政策性金融债	250,108,587.82	7.11
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	319,974,728.45	9.09
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,918,353,291.82	54.50
8	其他	-	-
9	合计	2,488,436,608.09	70.69
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 5.6 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	111608051	16 中信 CD051	2,000,000	199,308,826.72	5.66
2	111607134	16 招行 CD134	1,500,000	149,625,851.18	4.25
3	160419	16 农发 19	1,300,000	130,063,156.41	3.69
4	041558105	15 蒙中电 CP001	1,000,000	99,989,057.68	2.84
5	111697586	16 九江银行 CD070	1,000,000	99,833,197.10	2.84
6	111697839	16 江苏江南农村 商业银行 CD127	1,000,000	99,788,121.75	2.83
7	111509279	15 浦发 CD279	1,000,000	99,755,947.32	2.83
8	111608130	16 中信 CD130	1,000,000	99,715,183.75	2.83
9	111696109	16 湖北银行 CD045	1,000,000	99,701,202.47	2.83
10	111611175	16 平安 CD175	1,000,000	99,655,330.62	2.83

#### 5.7 “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	0.1412%
报告期内偏离度的最低值	0.0343%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0712%

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%。

### 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)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	131805	海尔优 B	638,500.00	63,850,000.00	1.81
2	131935	花呗 02A1	290,000.00	29,000,000.00	0.82

### 5.9 投资组合报告附注

#### 5.9.1 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。

5.9.2 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。

#### 5.9.3 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	12,769,807.14
4	应收申购款	694,341.80
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	13,464,148.94

#### 5.9.4 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。

## § 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	136,329,900.93	2,655,508,886.96
报告期基金总申购份额	459,835,721.30	10,444,818,824.87
报告期基金总赎回份额	482,881,671.89	9,693,565,063.57

报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	113,283,950.34	3,406,762,648.26

## § 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 2016 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理 138 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，管理资产总规模约为 5,359.54 亿元人民币，其中公募基金规模约 2,912.48 亿元人民币，累计分红约 738.04 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，2016 年三季度，博时旗下基金业绩依然领先。

截至 9 月 30 日，权益类方面，标准指数股票型基金中，博时中证淘金大数据 100 指数基金、博时中证银行指数分级，今年以来净值增长率在同类型 316 只基金中排名前 10；偏股型基金里，博时行业轮动基金、博时主题行业混合基金，今年以来净值增长率在同类 372 只基金中排名前 20；灵活配置型基金中，博时灵活配置混合 A，今年以来净值增长率在同类排名前 1/10；保本型基金中，博时招财一号大数据保本混合，今年以来净值增长率在同类排名前 1/4；绝对收益目标基金中，博时新财富混合基金今年以来净值增长率为 5.36%，在同类 165 只基金中排名前 1/7。

黄金基金中，博时黄金 ETF (D 类) 今年以来净值增长率为 28.42%，在同类 8 只基金中排名第一。

固定收益方面，标准债券型基金中，博时双月薪定期支付债券、博时月月薪定期支付债券，今年以来净值增长率分别为 6.91%、5.23%，在同类型 61 只基金中分别第二

和第五，博时信用债纯债排名前 1/9；普通债券型基金里，稳健回报债券（LOF）今年以来净值增长率在同类排名前 1/4；货币市场基金里，博时外服货币，今年以来净值增长率在同类 194 只排名第五；封闭式标准债券基金中，博时安丰 18 个月定开债今年以来净值增长率在同类排名前 1/4。

QDII 基金方面，博时亚洲票息，今年以来至 9 月 30 日净值增长 9.98%，在同类 QDII 债券基金 11 只中排名前 1/2。

## 2、其他大事件

•2016 年 8 月 5 日，由 21 世纪经济报道主办的“2016 深港通论坛暨 ‘金帆奖’ 系列颁奖礼上，博时一举斩获 2016 年综合实力十强基金公司奖、2016 年互联网突出表现奖、2016 年 ABS 最具实力管理人奖（博时资本）三项大奖。

## § 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  
二〇一六年十月二十四日