

博时天天增利货币市场基金  
2018 年年度报告（摘要）  
2018 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：二〇一九年三月二十九日

---

## § 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 2019 年 3 月 28 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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	
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	1,301,778,057.84 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	58,453,248.12 份	1,243,324,809.72 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	010-66594942

### 2.4 信息披露方式

登载基金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>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2018 年		2017 年		2016 年	
	博时天天增利货币 A	博时天天增利货币 B	博时天天增利货币 A	博时天天增利货币 B	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	2,365,274.34	113,201,433.62	6,183,728.21	258,768,394.56	3,934,960.67	85,892,013.04
本期利润	2,365,274.34	113,201,433.62	6,183,728.21	258,768,394.56	3,934,960.67	85,892,013.04
本期净值收益率	2.8511%	3.0988%	3.4257%	3.6713%	2.4510%	2.6960%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
	博时天天增利货币 A	博时天天增利货币 B	博时天天增利货币 A	博时天天增利货币 B	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	58,453,248.12	1,243,324,809.72	138,391,674.21	2,079,772,052.52	1,063,766,825.89	12,606,117,590.81
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

注：1、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。通常情况下本基金的收益结转方式为按日结转，对于目前暂不支持按日结转的销售机构，仍保留按月结转的方式。基金份额分类后，本基金将分设 A 级和 B 级两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，分别公布每万份基金净收益、七日年化收益率，并按照不同的费率计提销售服务费用。

#### 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	份额净值收益率标准差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	0.6009%	0.0015%	0.3403%	0.0000%	0.2606%	0.0015%
过去六个月	1.1988%	0.0020%	0.6805%	0.0000%	0.5183%	0.0020%
过去一年	2.8511%	0.0020%	1.3500%	0.0000%	1.5011%	0.0020%
过去三年	9.0162%	0.0027%	4.0500%	0.0000%	4.9662%	0.0027%
自基金合同生效起至今	14.2358%	0.0040%	5.8771%	0.0000%	8.3587%	0.0040%

2. 博时天天增利货币 B:

阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 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	0.6618%	0.0015%	0.3403%	0.0000%	0.3215%	0.0015%
过去六个月	1.3214%	0.0020%	0.6805%	0.0000%	0.6409%	0.0020%
过去一年	3.0988%	0.0020%	1.3500%	0.0000%	1.7488%	0.0020%
过去三年	9.8052%	0.0027%	4.0500%	0.0000%	5.7552%	0.0027%
自基金合同生效 起至今	15.4381%	0.0040%	5.8771%	0.0000%	9.5610%	0.0040%

注：本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

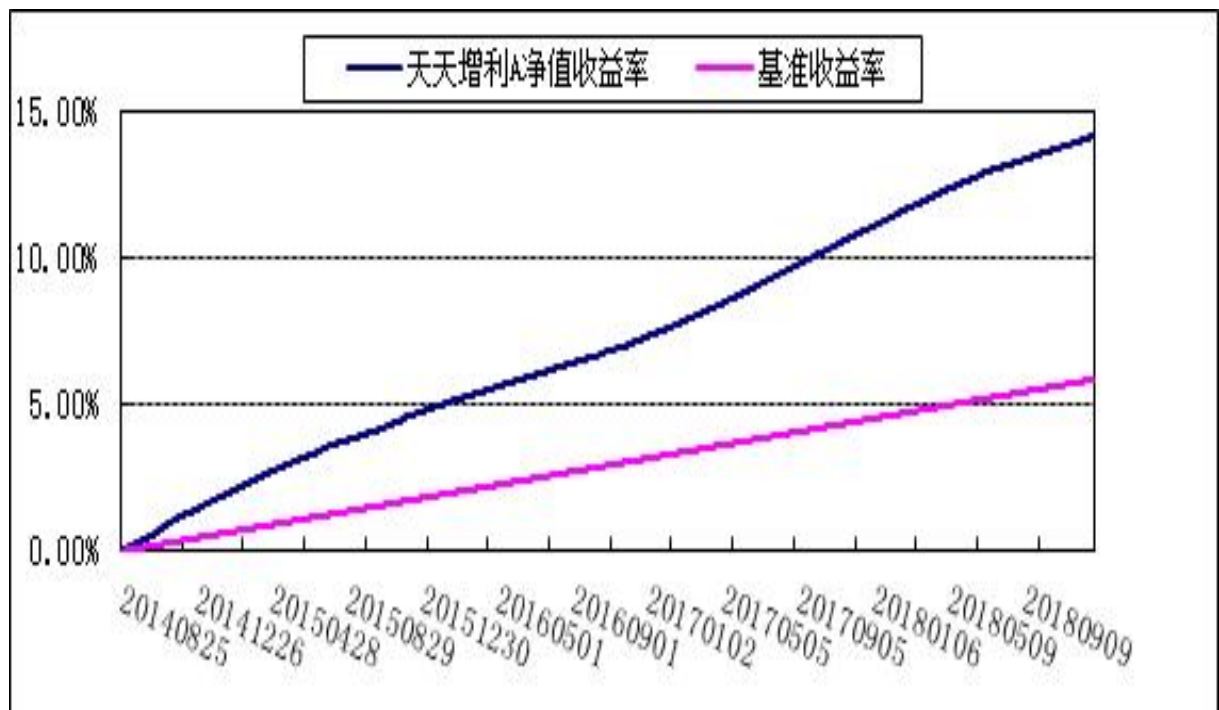
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时天天增利货币市场基金

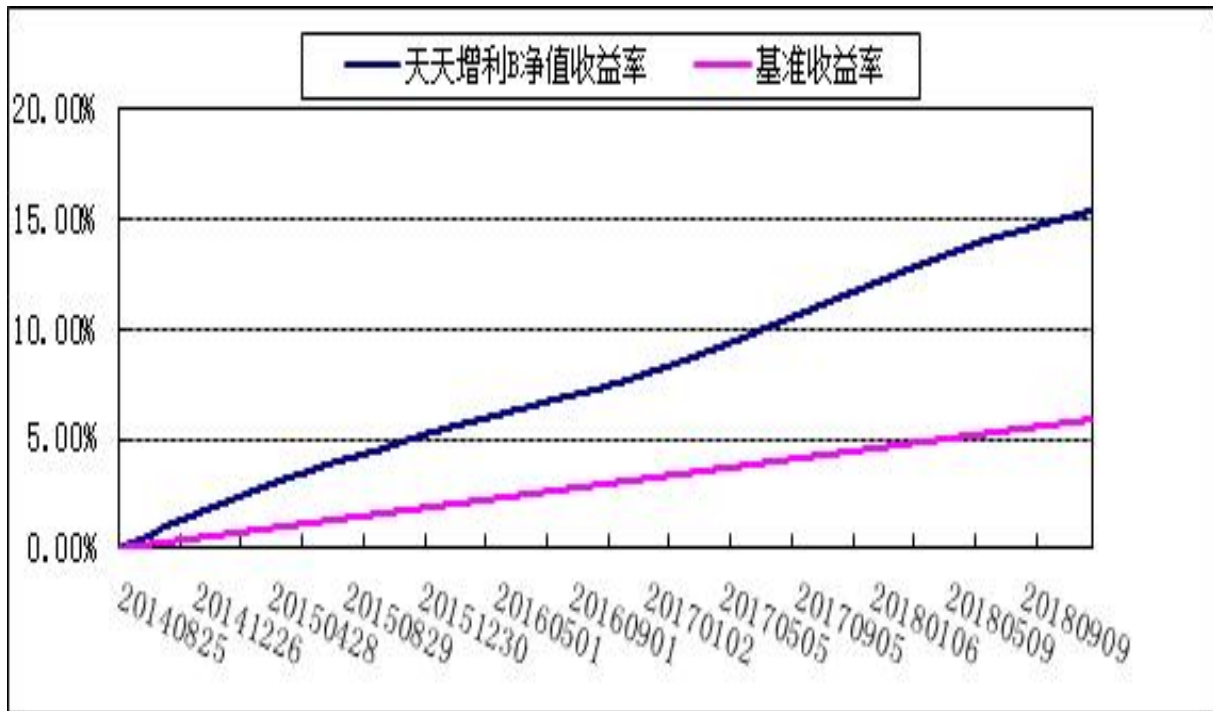
自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014 年 8 月 25 日至 2018 年 12 月 31 日)

1、博时天天增利货币 A



2、博时天天增利货币 B

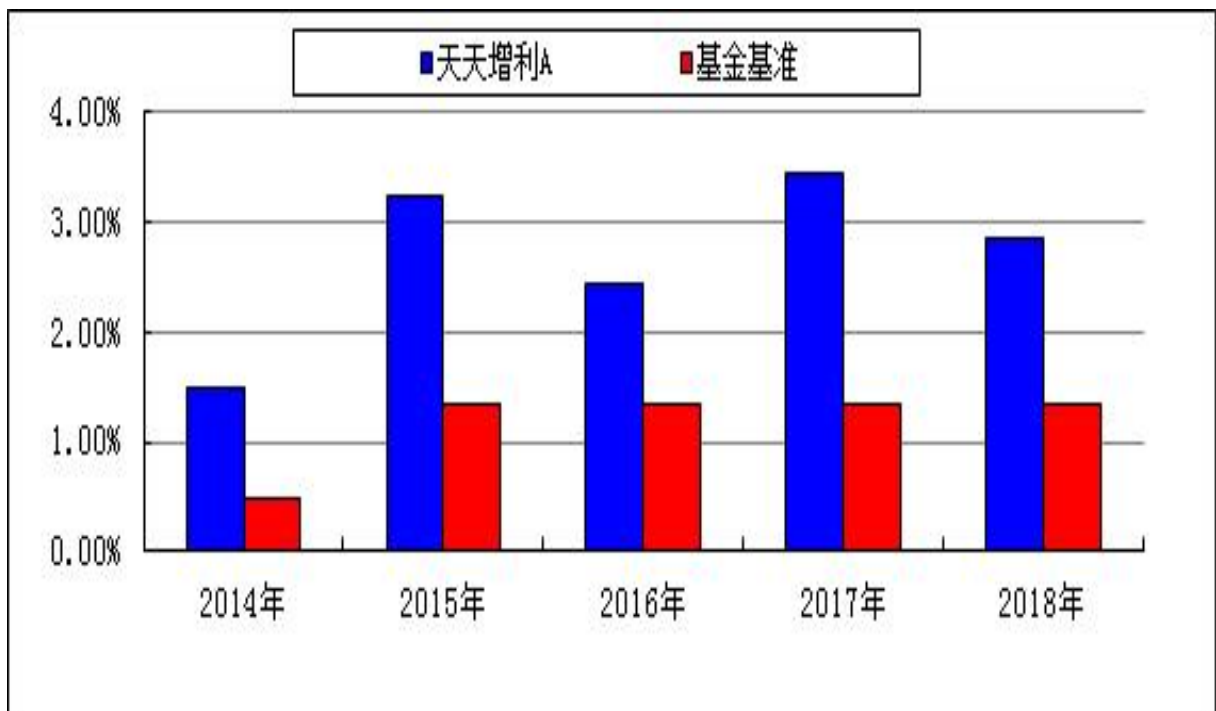


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

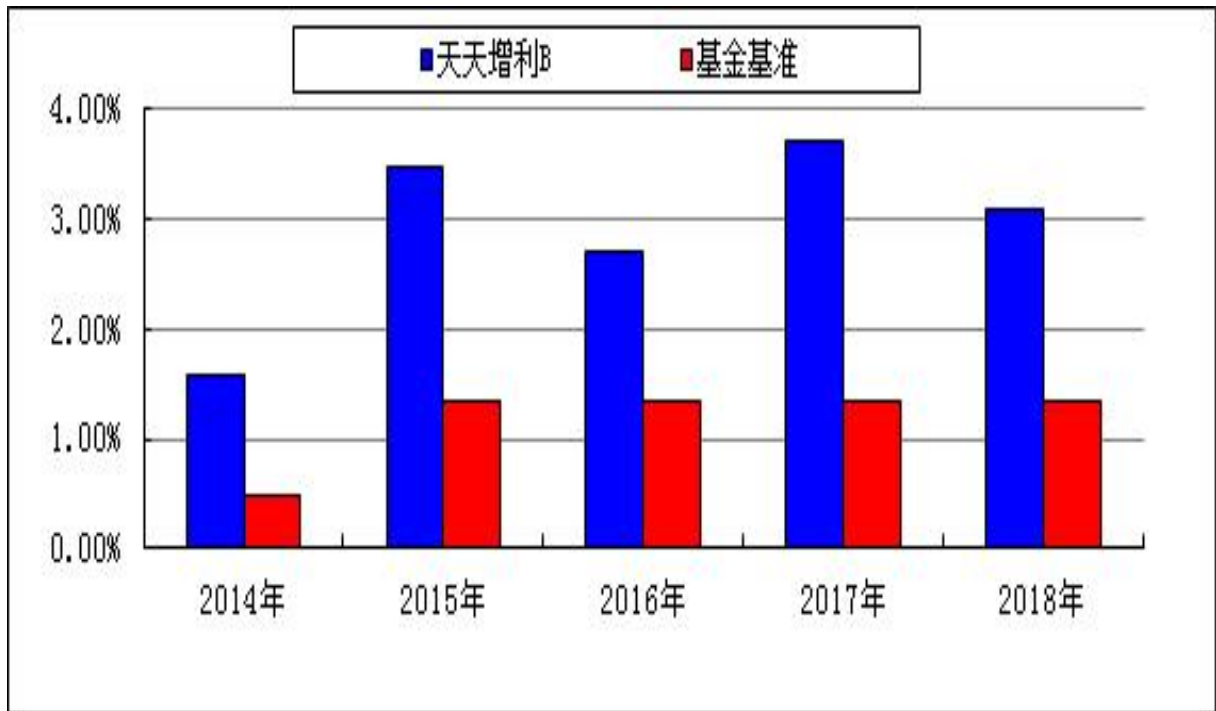
#### 博时天天增利货币市场基金

自基金合同生效以来基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

#### 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，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 博时天天增利货币 A:

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付赎回款 转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2018 年	2,372,089.52	-	-6,815.18	2,365,274.34	-
2017 年	6,276,197.41	-	-92,469.20	6,183,728.21	-
2016 年	3,836,071.19	-	98,889.48	3,934,960.67	-
合计	12,484,358.12	-	-394.90	12,483,963.22	-

#### 博时天天增利货币 B:

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付赎回款 转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2018 年	113,263,319.86	-	-61,886.24	113,201,433.62	-
2017 年	259,888,086.61	-	-1,119,692.05	258,768,394.56	-
2016 年	84,740,869.94	-	1,151,143.10	85,892,013.04	-
合计	457,892,276.41	-	-30,435.19	457,861,841.22	-

## § 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 2018 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 181 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，管理资产总规模逾 8638 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 2439 亿元人民币，累计分红逾 916 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，截至 2018 年 4 季末：

博时固定收益类基金业绩表现亮眼。在参与银河排名的 107 只固收产品（各类份额分开计算）中，有 54 只产品银河同类排名前 1/2。债券型基金中，博时宏观回报债券 A/B 类、博时宏观回报债券 C 类 2018 年全年净值增长率均分别在 200 只、142 只同类基金中排名第 1，博时天颐债券 A 类 2018 年全年净值增长率在 200 只同类基金中排名第 4，博时天颐债券 C 类 2018 年全年净值增长率在 142 只同类基金中排名第 5，博时富华纯债债券、博时富瑞纯债债券、博时裕康纯债债券、博时双月薪定期支付债券 2018 年全年净值增长率排名均在银河同类前 1/10，博时富发纯债债券、博时裕利纯债债券、博时富益纯债债券 2018 年全年净值增长率排名均在银河同类前 1/8；货币型基金中，博时合惠货币 B 类、博时现金宝货币 B 类 2018 年全年净值增长率分别在 291 只同类基金中排名第 8、第 29，博时合惠货币 A 类 2018 年全年净值增长率在 311 只同类基金中排名第 11。

博时旗下权益类基金业绩表现稳健。2018 年 A 股市场震荡下行，博时旗下参与银河排名的 83 只权益产品（各类份额分开计算）中，56 只银河同类排名在前 1/2。其中，股票型基金里，博时工业 4.0 主题、博时丝路主题业绩排名均在银河同类前 1/4；混合型基金中，博时乐臻定开混合 2018 年全年净值增长率在 44 只同类基金中均排名第 4，博时新兴消费主题、博时汇智回报、博时新策略 A 类、博时新收益等基金业绩排名在银河同类前 1/10，博时逆向投资、博时战略新兴产业、博时裕隆、博时鑫泰 A 类等基金业绩排名在银河同类前 1/4；指数基金中，博时上证超大盘 ETF 及其联接基金等基金业绩排名在银河同类前 1/10，博时上证 50ETF 及其联接基金 A 类业绩排名在银河同类前 1/6，博时沪深 300 指数业绩排名在银河同类前 1/3。

商品型基金当中，博时黄金 ETF 联接 A 类 2018 年全年净值增长率同类排名第 1。

QDII 基金方面，博时标普 500ETF、博时标普 500ETF 联接 A 类 2018 年全年净值增长率银河同



类排名均位于前 1/3。

## 2、其他大事件

2018 年 12 月 28 日，由新华网主办的第十一届“中国企业社会责任峰会”暨 2018 中国社会责任公益盛典在京隆重举行。凭借多年来对责任投资的始终倡导和企业公民义务的切实履行，老牌公募巨头博时基金在本次公益盛典上荣获“2018 中国社会责任杰出企业奖”。

2018 年 12 月 22 日，东方财富在南京举办的“2018 东方财富风云榜暨基情 20 年”颁奖典礼上，博时基金喜获两项大奖，博时基金江向阳总经理获得“基情 20 周年最受尊敬行业领袖”奖；博时主题行业混合（LOF）荣登“天天基金年度产品热销榜”。

2018 年 12 月 21 日，由华夏时报社主办的“华夏机构投资者年会暨第十二届金蝉奖颁奖盛典”在北京召开，本次年会的主题是“金融业 2019 年：突破与回归”，博时基金荣获“2018 年度基金管理公司”。

2018 年 12 月 21 日，由北京商报社、北京品牌协会主办的“科技赋能与金融生态再造”——2018 年度（第四届）北京金融论坛在京成功举办，博时基金荣获“技术领先价值奖”。

2018 年 12 月 15 日，第二届腾讯理财通金企鹅奖暨财富高峰论坛在深圳举行。会上揭晓了第二届金企鹅奖获奖名单，其中博时安盈债券基金（A 类：000084、C 类：000085）凭借年内出色的业绩表现以及在 90 后用户中的超高人气，一举斩获“最受 90 后用户喜爱的产品奖”。

2018 年 11 月 16 日，由《每日经济新闻》主办的“2018 公募基金高峰论坛暨金鼎奖颁奖典礼”在成都举行，凭借突出的资管实力和对价值投资的坚守，博时基金一举摘得“公募 20 年特别贡献奖——创造收益”这一重磅奖项，同时，旗下专户板块获“专户业务最具竞争力基金公司”奖。

2018 年 11 月 1 日，博时基金正式加入联合国责任投资原则组织（简称 UN PRI），成为中国较早加入 UN PRI 国际组织的资产管理机构之一。

2018 年 10 月 17 日，由南方财经全媒体集团和 21 世纪传媒举办的 21 世纪国际财经峰会暨“金帆奖”评选在深圳举行，凭借对价值投资理念的坚守和出色的综合资管能力，博时基金一举斩获“2018 年度基金管理公司金帆奖”这一重磅奖项。

2018 年 9 月 7 日，由证券时报主办的“2018 中国 AI 金融探路者峰会暨第二届中国金融科技先锋”榜颁奖典礼在深圳举行，凭借长期的敬业精神和沉淀的创新思维，博时基金副总裁王德英获得了“2018 中国金融科技领军人物先锋”的荣誉。

2018 年 9 月 6-9 日，在阿拉善生态基金会主办，深圳证券信息、全景网协办，深交所、证券业协会、基金业协会、期货业协会、上市公司协会等单位支持的“2018 第三届绿色行走公益长征

暨沙漠穿越挑战·赛”中，由 4 名博时员工朱盟（信息技术部）、过钧（固定收益总部）、王飞（信息技术部）、王盼（信息技术部）组成的代表队，成功穿越内蒙古阿拉善盟腾格里沙漠，率先全员抵达终点获得团体冠军，其中王飞更获得个人第一。

2018 年 8 月，全国社会保障基金境内委托投资管理人 2017 年度考评结果出炉，博时基金投研能力获得高度认可，在公司基本面单项考评中获 A 档，三个社保委托组合获评“综合考评 A 档”，此为社保考评结果的最高档。同时，在社保投资经理的考评中，博时基金共收获 3 项个人奖项。博时基金副总裁兼高级投资经理董良泓独揽社保理事会特别颁发的“10 年长期贡献社保表彰”，用于肯定其过去十年在同一家公司管理社保组合，含金量极高。同时，董良泓本人还摘得“10 年贡献社保表彰”的殊荣，该奖项授予长期为社保服务且业绩优秀的投资管理人，本次仅授予 2 人。此外，博时基金董事总经理兼年金投资部总经理欧阳凡获评“3 年贡献社保表彰”。

2018 年 7 月 19 日，由中国证券投资基金业协会主办的“中国基金业 20 周年——发展中的思考与启示”主题论坛在深圳隆重举行。博时基金凭借雄厚的资管实力、出色的投研业绩、锐意创新的拼搏精神获得基金业协会的高度认可，一举摘得“优秀基金管理人”大奖；副总经理王德英此次荣获“杰出专业人士”的殊荣。同时，博时主题行业混合（LOF）（160505）更是以长期优异的业绩上榜“优秀基金产品”。

2018 年 6 月 8 日，由《中国证券报》主办的中国基金业二十周年高峰论坛暨第十五届“中国基金业金牛奖”颁奖典礼在苏州隆重举行。经过激烈且公平的票选，博时基金获得“2017 年度最受信赖金牛基金公司”荣誉称号。

2018 年 5 月 24 日，由《中国基金报》、《证券时报》主办的“第五届中国基金业英华奖、中国基金业 20 年最佳基金经理评选颁奖典礼暨高峰论坛”在深圳隆重举行。从业经历逾 23 年的博时基金副总经理兼高级投资经理董良泓荣获“中国基金业 20 年最佳基金经理”殊荣，此荣誉于全行业仅有 20 人获评；博时基金固收名将陈凯杨则凭借长期稳健的投资业绩荣膺“三年期纯债投资最佳基金经理”称号。值得一提的是，这也是陈凯杨继 2016 年之后连续两年蝉联该项殊荣，足见市场对其管理业绩的认可。

2018 年 5 月 23 日，由新浪财经和济安金信主办的“致敬公募 20 年”颁奖典礼在北京举行，公募基金老五家之一的博时基金凭借长期优良的投研业绩、雄厚的综合资管实力和对价值投资理念的一贯倡导共揽获“最佳资产管理公司”、“最受投资者欢迎基金公司”、“行业特别贡献奖”和“区域影响力奖-珠三角”这四项最具份量的公司大奖；博时基金总经理江向阳获得“行业领军人物奖”。同时，博时旗下产品博时双月薪定期支付债券基金（000277）获得“最具价值理念基金产品奖-债券型”，博时亚洲票息收益债券（QDII）（人民币 050030：，美元现汇：050202，美元现

钞：050203）获得“最具投资价值基金产品奖-QDII”。

2018 年 5 月 17 日，被誉为“证券期货行业科学技术领域最高荣誉”的第六届证券期货科学技术奖的评审结果近日在北京揭晓。博时基金从上百个竞争对手中脱颖而出，一举夺得二等奖（DevOps 统一研发平台）、三等奖（证券投资基金行业核心业务软件系统统一测试）以及优秀奖（新一代基金理财综合业务接入平台）三项大奖，成为获得奖项最多的金融机构之一。

2018 年 5 月 10 日，由《上海证券报》主办的“2018 中国基金业峰会暨第十五届金基金奖颁奖典礼”在上海举行。在此次颁奖典礼上，博时基金揽获“金基金 TOP 基金公司”这一最具份量的公司大奖；博时基金权益投资总部董事总经理兼股票投资部总经理李权胜获评“金基金最佳投资回报基金经理奖”。在第 15 届金基金奖评选中，旗下价值投资典范产品博时主题行业（160505）获得“三年期金基金分红奖”。

2018 年 3 月 26 日，第十五届中国基金业金牛奖评奖结果也拉开帷幕。公募“老五家”之一的博时基金凭借长期出色的投资业绩、锐意进取的创新姿态和对价值投资的坚守一举夺得全场份量最重的“中国基金业 20 年卓越贡献公司”大奖。同时，旗下绩优产品博时主题行业混合（LOF）（160505）荣获“2017 年度开放式混合型金牛基金”奖；博时信用债纯债债券（050027）荣获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2018 年 3 月 22 日，由中国基金报、香山财富论坛主办的“第五届中国机构投资者峰会暨中国基金业英华奖公募基金 20 周年特别评选、中国基金业明星基金奖颁奖典礼”在北京举办，本次评选中，博时基金一举斩获本届“20 周年特别评选”中最具分量的两项公司级大奖——公募基金 20 年“十大最佳基金管理人”奖和“最佳固定收益基金管理人”奖，同时，旗下明星基金博时主题行业、博时信用债券分别将“最佳回报混合型基金”奖和“最佳回报债券型基金（二级债）”奖双双收入囊中，博时聚润纯债债券则获得“2017 年度普通债券型明星基金”奖。

2018 年 2 月 2 日，由金融界举办“第二届智能金融国际论坛”暨第六届金融界“领航中国”年度盛典在南京举办，此次论坛以“安全与创新”为主题，邀请业内专家学者就现阶段行业发展的热点问题深入探讨。博时基金凭借优异的业绩与卓越的品牌影响力斩获“五年期投资回报基金管理公司奖”和“杰出品牌影响力奖”两项大奖。

2018 年 1 月 11 日，由中国基金报主办的“中国基金产品创新高峰论坛暨中国基金业 20 年最佳创新产品奖颁奖典礼”在上海举办。博时基金一举摘得“十大产品创新基金公司奖”，旗下产品博时主题行业混合基金（160505）和博时黄金 ETF 分别获得“最佳主动权益创新产品奖”和“最佳互联网创新产品奖”，成为当天最大赢家之一。

2018 年 1 月 9 日，由信息时报主办的“第六届信息时报金狮奖——2017 年度金融行业风云榜

颁奖典礼”在广州隆重举行。博时基金凭借优秀的基金业绩和广泛的社会影响力荣获“年度最具影响力基金公司”大奖。

#### 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 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
鲁邦旺	基金经理	2017-04-26	-	9	鲁邦旺先生，硕士。2008 年至 2016 年在平安保险集团公司工作，历任资金经理、固定收益投资经理。2016 年加入博时基金管理有限公司。历任博时裕丰纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2017 年 10 月 17 日)、博时裕和纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2017 年 10 月 19 日)、博时裕盈纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2017 年 10 月 25 日)、博时裕嘉纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2017 年 11 月 15 日)、博时裕坤纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2018 年 2 月 7 日)、博时裕晟纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日-2018 年 8 月 10 日)、博时安慧 18 个月定期开放债券型证券投资基金(2017 年 12 月 29 日-2018 年 9 月 6 日)的基金经理。现任博时裕泰纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日—至今)、博时裕恒纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日—至今)、博时裕瑞纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日—至今)、博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金

					<p>(2016 年 12 月 15 日一至今)、博时裕达纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日一至今)、博时裕康纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日一至今)、博时裕荣纯债债券型证券投资基金(2016 年 12 月 15 日一至今)、博时天天增利货币市场基金(2017 年 4 月 26 日一至今)、博时保证金实时交易型货币市场基金(2017 年 4 月 26 日一至今)、博时裕丰纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2017 年 10 月 18 日一至今)、博时裕盈纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2017 年 10 月 26 日一至今)、博时裕嘉纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2017 年 11 月 16 日一至今)、博时裕坤纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 2 月 8 日一至今)、博时兴荣货币市场基金(2018 年 3 月 19 日一至今)、博时富业纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2018 年 7 月 2 日一至今)的基金经理。</p>
倪玉娟	基金经理助理	2015-12-21	2018-04-09	7.4	<p>2011 年至 2014 年在海通证券任固定收益分析师。2014 年加入博时基金管理有限公司，历任高级研究员、高级研究员兼基金经理助理。现任博时富瑞纯债债券型证券投资基金、博时悦楚纯债债券型证券投资基金的基金经理。</p>

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，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了《公平交易管理制度》，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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

2018 年货币政策基调发生转向，由 2017 年的实际偏紧变为实际偏宽松，流动性环境相应地从合理稳定调整为合理充裕。上半年金融去杠杆力度显著减弱，货币政策无需再维持偏紧，央行两度降准释放流动性，货币市场工具利率中枢水平显著下移。下半年，中美贸易摩擦不断升级，引发市场对于未来经济增长的担忧。同时资管新规带来的信用紧缩和社融增速下行压力不断加大，央行再度两次降准进行对冲，流动性宽松程度进一步加深，货币市场利率继续下行。年初至年末，股份制银行 3M 同业存单发行利率自 4.60% 下行至 3.45%，降幅 115bp；1Y 同业存单发行利率从 4.85% 下调至 3.40%，下降 145bp。

在货币市场利率中枢下行过程中，央行还通过及时足量的公开市场操作进行“削峰填谷”，平滑月末、季末、春节以及缴税等时点资金面的异常波动，有效引导了市场对于流动性的预期。

组合操作方面，本基金根据对货币市场工具利率走势的判断结合组合流动性特点，在满足赎回需求的基础上抓住利率冲高时点大力配置银行存款和同业存单等资产，同时尽量拉长组合平均剩余期限，产品取得了较好的投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日，报告期内，本基金 A 基金份额净值收益率为 2.8511%，本基金 B 基金份额净值收益率为 3.0988%，同期业绩基准收益率 1.3500%。

#### 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 2019 年，出口和消费增长依然乏力，在房地产难以大幅放松的前提下仅依靠基建投资难以显著拉动经济增长，经济基本面中短期内下行压力犹在。在该宏观背景下，货币政策基调料将维持稳健中性，流动性环境保持宽松。随着外围发达经济体经济增长动能下行甚至出现货币政策放松，国内货币政策顺势放松的空间也将随之打开。反映到利率上，预计随着资金利率稳定在低位甚至下行，存款、存单等货币市场工具利率水平仍有少许下行空间。

本基金将坚持作为流动性管理工具的定位，根据货币市场利率趋势灵活调整组合平均剩余期限和资产结构，合理安排到期现金流分布，并根据货币市场利率水平适度调整组合杠杆，在保证组合安全性和流动性的基础上争取获得更佳的投资回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

2018 年，我公司根据法律、法规的规定，制定了《合规管理制度》、《养老目标证券投资基金子基金选择标准与制度》等制度。修订了《合规考核管理制度》、《投资决策委员会制度》、《债券型基金投资股票管理流程》等制度文件，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断建设及完善“新一代投资决策支持系统”、“博时客户关系管理系统”、“博时投资决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》

的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

#### 4.7 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债金融估值中心有限公司签署服务协议，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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：本基金采用 1.00 元固定份额净值交易方式，自基金合同生效日起，每日将基金净收益（或净损失）分配给基金份额持有人，当日收益参与下一日的收益分配，并定期结转为相应的基金份额。通常情况下，本基金的收益结转方式为按日结转，对于目前暂不支持按日结转的销售机构，暂采用按月结转的方式。不论何种支付方式，当日收益均参与下一日的收益分配。本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资人不记收益；若累计未结转收益为正值，在收益结转时，为投资人增加相应的基金份额，当投资人全部赎回其持有的基金份额时，其累计未结转收益将被一并赎回；若累计未结转收益为负值，则缩减投资人的基金份额，当投资人赎回基金份额时，将按比例从赎回款中扣除，剩余部分缩减投资人的基金份额。

本基金 A 类本报告期内向份额持有人分配利润 2,365,274.34 元；本基金 B 类本报告期内向份额持有人分配利润 113,201,433.62 元。



#### 4.9 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遵规守信、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、基金净值收益率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 审计报告

---

本报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

### § 7 年度财务报表

---

## 7.1 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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	532,947,487.00	634,132,511.07
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	498,564,618.47	1,233,377,587.38
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	458,564,618.47	1,203,377,587.38
资产支持证券投资	40,000,000.00	30,000,000.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	262,565,753.85	338,301,827.44
应收证券清算款	-	-
应收利息	9,090,715.43	14,266,095.83
应收股利	-	-
应收申购款	3,310.00	217,196.26
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>1,303,171,884.75</b>	<b>2,220,295,217.98</b>
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：	-	-
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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	571,832.47	1,124,724.36
应付托管费	173,282.56	340,825.58
应付销售服务费	29,319.06	58,607.77
应付交易费用	33,972.36	57,226.35
应交税费	3,714.69	-
应付利息	-	-
应付利润	172,405.77	241,107.19

递延所得税负债	-	-
其他负债	409,300.00	309,000.00
<b>负债合计</b>	<b>1,393,826.91</b>	<b>2,131,491.25</b>
<b>所有者权益：</b>	-	-
实收基金	1,301,778,057.84	2,218,163,726.73
未分配利润	-	-
<b>所有者权益合计</b>	<b>1,301,778,057.84</b>	<b>2,218,163,726.73</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>1,303,171,884.75</b>	<b>2,220,295,217.98</b>

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,301,778,057.84 份，其中 A 类基金份额总额 58,453,248.12 份，B 类基金份额总额 1,243,324,809.72 份。

## 7.2 利润表

会计主体：博时天天增利货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>134,321,621.86</b>	<b>302,618,517.31</b>
1. 利息收入	134,258,990.02	302,513,754.04
其中：存款利息收入	35,154,312.44	168,563,690.52
债券利息收入	59,487,762.36	87,376,333.02
资产支持证券利息收入	1,296,291.27	1,392,843.00
买入返售金融资产收入	38,320,623.95	45,180,887.50
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	55,115.64	55,635.98
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	55,115.64	55,635.98
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
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）	7,516.20	49,127.29
<b>减：二、费用</b>	<b>18,754,913.90</b>	<b>37,666,394.54</b>
1. 管理人报酬	12,655,516.32	24,301,267.73

2. 托管费	3,835,005.03	7,364,020.57
3. 销售服务费	579,541.20	1,184,923.37
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	1,164,937.69	4,267,354.28
其中：卖出回购金融资产支出	1,164,937.69	4,267,354.28
6. 税金及附加	4,666.75	-
7. 其他费用	515,246.91	548,828.59
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>115,566,707.96</b>	<b>264,952,122.77</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>115,566,707.96</b>	<b>264,952,122.77</b>

### 7.3 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	2,218,163,726.73	-	2,218,163,726.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	115,566,707.96	115,566,707.96
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）	-916,385,668.89	-	-916,385,668.89
其中：1. 基金申购款	29,191,146,725.60	-	29,191,146,725.60
2. 基金赎回款	-30,107,532,394.49	-	-30,107,532,394.49
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）	-	-115,566,707.96	-115,566,707.96
五、期末所有者权益（基金净值）	1,301,778,057.84	-	1,301,778,057.84
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	13,669,884,416.70	-	13,669,884,416.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	264,952,122.77	264,952,122.77

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）	-11,451,720,689.97	-	-11,451,720,689.97
其中：1. 基金申购款	58,642,145,730.20	-	58,642,145,730.20
2. 基金赎回款	-70,093,866,420.17	-	-70,093,866,420.17
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）	-	-264,952,122.77	-264,952,122.77
五、期末所有者权益（基金净值）	2,218,163,726.73	-	2,218,163,726.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳

主管会计工作负责人：王德英

会计机构负责人：成江

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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

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。

### 7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年

1 月 1 日起 产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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，应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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.3 关联方关系

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、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、基金销售机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时基金（国际）有限公司	基金管理人的子公司

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。

#### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.4.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.4.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.4.1.3 债券交易

无。

###### 7.4.4.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债	成交金额	占当期债券

		券回购成交总额的 比例		回购成交总 额的比例
招商证券	-	-	1,179,000,000.00	100.00%

#### 7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月 31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,655,516.32	24,301,267.73
其中：支付销售机构的客户 维护费	144,752.12	527,688.74

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。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月 31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,835,005.03	7,364,020.57

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。

##### 7.4.4.2.3 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 2018年1月1日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时天天增利货币 A	博时天天增利货币 B	合计
博时基金	53,618.22	366,813.80	420,432.02
中国银行	36,839.43	896.73	37,736.16
招商证券	8,159.24	2,642.33	10,801.57

合计	98,616.89	370,352.86	468,969.75
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时天天增利货币A	博时天天增利货币B	合计
博时基金	67,438.84	656,573.79	724,012.63
中国银行	70,198.45	1,399.53	71,597.98
招商证券	61,432.80	20,671.19	82,103.99
合计	199,070.09	678,644.51	877,714.60

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。

#### 7.4.4.3 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

本期 2018年1月1日至2018年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	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	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	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	1,648,201,433.29	-	-	-	-	-

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	博时天天增利货币A	博时天天增利货币B	博时天天增利货币A	博时天天增利货币B
报告期初持有的基金份额	-	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	767,468,628.86



报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	767,468,628.86
报告期末持有的基金份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-

注：1. 申购含红利再投、转换入、级别调整入份额，赎回含转换出、级别调整出份额。

2. 基金管理人在本年度本基金的交易委托博时基金直销柜台办理，无申购及赎回费。

#### 7.4.4.4.2 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

##### 博时天天增利货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
博时资本管理有限公司	8,118,223.75	0.62%	-	-

#### 7.4.4.5 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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	3,947,487.00	43,132.81	6,132,511.07	221,371.96
中国银行-定期存款	-	400,750.00	-	8,606,995.59

注：本基金的活期银行存款和部分定期存款由基金托管人中国银行保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.5 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

无。

#### 7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 498,564,618.47 元，无属于第一或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第二层次 1,233,377,587.38 元，无属于第一或第三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	498,564,618.47	38.26
	其中：债券	458,564,618.47	35.19
	资产支持证券	40,000,000.00	3.07
2	买入返售金融资产	262,565,753.85	20.15
	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	532,947,487.00	40.90
4	其他各项资产	9,094,025.43	0.70
5	合计	1,303,171,884.75	100.00

### 8.2 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	1.53	
	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	-	-
	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例 (%)	原因	调整期
1	2018-12-25	31.48	巨额赎回	1 个交易日

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 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	48
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	54
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	15

### 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。

#### 8.3.2 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	42.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	30.64	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	13.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	3.07	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	9.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.41	-

#### 8.4 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存续期未超过 240 天。

#### 8.5 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	140,056,374.15	10.76
	其中：政策性金融债	140,056,374.15	10.76
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	318,508,244.32	24.47
8	其他	-	-
9	合计	458,564,618.47	35.23

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。

### 8.6 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	180301	18 进出 01	1,000,000	100,024,783.91	7.68
2	111807114	18 招商银行 CD114	1,000,000	99,586,538.38	7.65
3	111821354	18 渤海银行 CD354	1,000,000	99,521,003.31	7.65
4	111816332	18 上海银行 CD332	500,000	49,901,245.31	3.83
5	111888721	18 宁波银行 CD229	500,000	49,817,029.58	3.83
6	140202	14 国开 02	200,000	20,017,561.97	1.54
7	180201	18 国开 01	200,000	20,014,028.27	1.54
8	111821201	18 渤海银行 CD201	200,000	19,682,427.74	1.51

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

### 8.7 “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	0.0588%
报告期内偏离度的最低值	-0.0270%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0200%

注：上表中“偏离情况”根据报告期内各交易日数据计算。

#### 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达到 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达到 0.5%。

### 8.8 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	139183	蚁信 05A	400,000.00	40,000,000.00	3.07

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 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。

8.9.2 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除 18 招商银行 CD114 的发行主体招商银行外，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。

2018 年 5 月 4 日，因招商银行股份有限公司存在内控管理严重违反审慎经营规则等违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会对其处以罚款、没收违法所得的行政处罚。

对该证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。

### 8.9.3 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	9,090,715.43
4	应收申购款	3,310.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	9,094,025.43

### 8.9.4 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	2,097	27,874.70	10,145,864.73	17.36%	48,307,383.39	82.64%
博时天天增利货币 B	14	88,808,914.98	1,243,324,809.72	100.00%	-	-
合计	2,111	616,664.17	1,253,470,674.45	96.29%	48,307,383.39	3.71%

## 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额 (份)	占总份额比例
1	券商类机构	607,710,920.04	46.68%
2	银行类机构	217,306,745.74	16.69%
3	保险类机构	200,343,126.93	15.39%
4	银行类机构	102,920,002.77	7.91%
5	基金类机构	50,456,093.17	3.88%
6	基金类机构	16,461,248.52	1.26%
7	基金类机构	10,526,480.97	0.81%
8	其他机构	10,003,953.24	0.77%
9	基金类机构	8,117,146.33	0.62%
10	银行类机构	7,359,168.91	0.57%

## 9.3 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时天天增利货币 A	346.63	0.00%
	博时天天增利货币 B	-	-
	合计	346.63	0.00%

## 9.4 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的情况

- 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。

## § 10 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	138,391,674.21	2,079,772,052.52

本报告期基金总申购份额	152,004,807.76	29,039,141,917.84
减：本报告期基金总赎回份额	231,943,233.85	29,875,589,160.64
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	58,453,248.12	1,243,324,809.72

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 11.2 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

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门发生的重大人事变动：2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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。本报告期内本基金应付审计费 100000 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----



	单元数量	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	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

### 11.7.2 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	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序	持有基金份额比例	期初余额	申购份额	赎回份额	持有份额	余额占

别	号	例达到或者超过20%的时间区间					比
机构	1	2018-01-31	-	509,215,706.18	509,215,706.18	-	-
	2	2018-07-19~2018-08-23	-	4,210,445,467.94	4,210,445,467.94	-	-
	3	2018-01-01~2018-01-02	502,666,649.70	824,318,687.44	1,326,985,337.14	-	-
	4	2018-06-14~2018-07-04;2018-08-31~2018-09-06;2018-09-26~2018-10-31	180,116,163.13	1,315,538,116.66	1,488,295,110.88	7,359,168.91	0.57%
	5	2018-03-02~2018-03-25;2018-05-10~2018-05-29	-	3,316,810,656.92	3,316,810,656.92	-	-
	6	2018-11-08~2018-11-12;2018-11-14~2018-12-24	-	1,002,273,096.37	1,002,273,096.37	-	-
	7	2018-01-31	-	501,954,065.28	501,954,065.28	-	-
	8	2018-06-20~2018-06-25	-	806,250,583.53	806,250,583.53	-	-
	9	2018-06-27~2018-07-18;2018-08-24~2018-12-27	-	1,317,306,745.74	1,100,000,000.00	217,306,745.74	16.69%
	10	2018-07-10~2018-07-18	-	1,201,202,400.72	1,201,202,400.72	-	-
	11	2018-12-27~2018-12-31	200,330,575.33	1,307,380,344.71	900,000,000.00	607,710,920.04	46.68%

#### 产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有

人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

注：申购份额包含红利再投资份额。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

博时基金管理有限公司  
二〇一九年三月二十九日