

# 博时中证银行指数分级证券投资基金

## 2016 年半年度报告

### 2016 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十五日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	28
7.1 期末基金资产组合情况	28
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	28
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	29
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	31
7.6 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	31
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	31
7.8 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贵金属投资明细	31
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	31
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	31
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	31
7.12 投资组合报告附注	31
§ 8 基金份额持有人信息	32

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	32
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	32
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	33
8.4 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情况 .....	33
§ 9 开放式基金份额变动 .....	33
§ 10 重大事件揭示 .....	34
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	34
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 .....	34
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	34
10.4 基金投资策略的改变 .....	34
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	34
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 .....	34
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	34
10.8 其他重大事件 .....	35
§ 11 备查文件目录 .....	35
11.1 备查文件目录 .....	35
11.2 存放地点 .....	36
11.3 查阅方式 .....	36

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时中证银行指数分级证券投资基金		
基金简称	博时银行分级基金		
基金主代码	160517		
交易代码	160517		
基金运作方式	契约型上市开放式		
基金合同生效日	2015 年 6 月 9 日		
基金管理人	博时基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	155,306,235.48 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 6 月 18 日		
下属分级基金的基金简称	博时银行	银行 A 类	银行 B 类
下属分级基金的场内简称	博时银行	银行 A 类	银行 B 类
下属分级基金的交易代码	160517	150267	150268
报告期末下属分级基金的份额总额	115,210,179.48 份	20,048,028.00 份	20,048,028.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数基金，跟踪指数为本基金的目标，力求将基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以下、年跟踪误差控制在 4% 以下。
投资策略	本基金以中证银行指数为标的指数，采用完全复制法，按照标的指数成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股构成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证银行指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为被动跟踪指数的股票型指数证券投资基金，属于证券投资基金当中较高预期风险、较高预期收益的品种。一般情形下，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。 就三级基金份额而言，博时银行份额为常规指数基金份额，具有预期风险较高、预期收益较高的特征；博时银行 A 份额具有低风险、预期收益相对稳定的特征；博时银行 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	田青
	联系电话	0755-83169999	010-67595096

电子邮箱	service@bosera.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话	95105568	010-67595096
传真	0755-83195140	010-66275853
注册地址	广东省深圳市福田区深南大道 7088号招商银行大厦29层	北京市西城区金融大街25号
办公地址	广东省深圳市福田区深南大道 7088号招商银行大厦29层	北京市西城区闹市口大街1号院1 号楼
邮政编码	518040	100033
法定代表人	张光华	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

# § 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（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-2,596,092.76
本期利润	-11,669,672.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0693
本期加权平均净值利润率	-8.53%
本期基金份额净值增长率	-7.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	-24,323,172.05
期末可供分配基金份额利润	-0.1566
期末基金资产净值	128,504,260.69
期末基金份额净值	0.8274
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-15.92%

## 3.2 基金净值表现

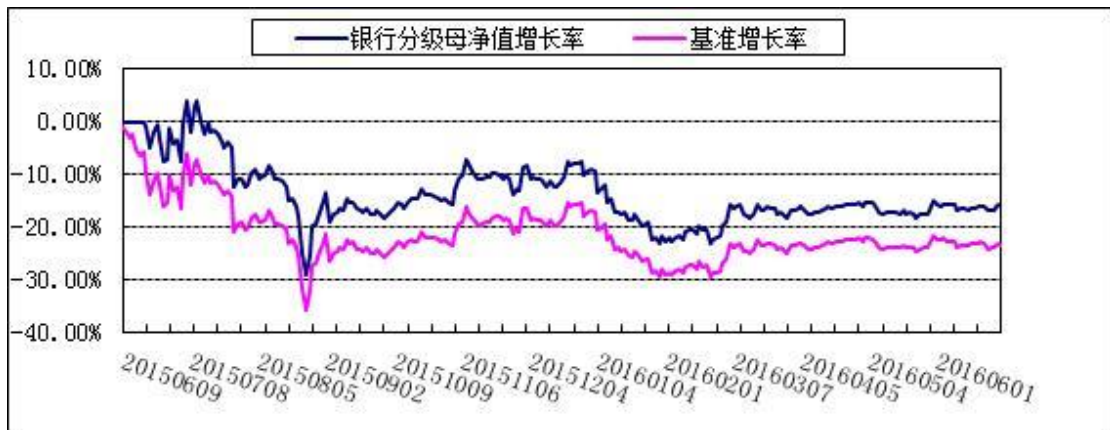
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-1.08%	0.51%	-2.27%	0.58%	1.19%	-0.07%

过去三个月	1.09%	0.57%	0.18%	0.60%	0.91%	-0.03%
过去六个月	-7.26%	1.21%	-7.76%	1.16%	0.50%	0.05%
过去一年	-14.97%	1.88%	-14.88%	1.87%	-0.09%	0.01%
自基金合同生效起至今	-15.92%	1.93%	-23.41%	1.95%	7.49%	-0.02%

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

博时中证银行指数分级证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015 年 6 月 9 日至 2016 年 6 月 30 日)



注：本基金合同于2015年6月9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 2016 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 117 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。资产管理净值总规模达 4,598.72 亿元人民币，其中公募基金资产规模 2497.59 亿元人民币，累计分红 724.58 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 年二季度，博时旗下基金业绩依然领先。



截至 6 月 30 日，偏股型基金中，行业轮动、创业成长、博时主题基金，今年以来净值增长率在同类型 374 只基金中排名前 1/10；标准指数股票型基金中，博时淘金 100 大数据、博时上证自然资源 ETF、中证银行指数分级基金，今年以来净值增长率在同类型 326 只基金中都排名在前 1/8；ETF 联接基金里，上证资源 ETF 联接今年以来净值增长率在同类 66 只中排名第二；灵活配置型基金里，博时灵活配置 A 今年以来净值增长率在同类 290 只排名前 1/10；保本型基金里，博时招财一号保本混合，今年以来净值增长率在同类 51 只中排名前 1/7；博时黄金 ETF 场外 D 类今年以来净值增长率为 27.5%，在同类 8 只排名第一。

固定收益方面，长期标准债券型基金中，博时信用债纯债基金今年以来净值增长率在同类排名前 1/8；指数债券型基金里，博时上证企债 30ETF 今年以来净值增长率在同类排名前 1/8；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 只排名第四，博时现金收益货币，今年以来净值增长率在同类 194 只基金中排名前 2/5；博时安丰 18 定期开放债券，今年以来净值增长率在同类 45 只中排名第四。

QDII 基金中，博时亚洲票息，今年以来至 6 月 30 日净值增长 7.12%，在同类 QDII 债券基金 11 只中排名第二。

## 2、其他大事件

•2016 年 6 月 24 日，由南方日报主办的一年一度“金榕奖”南方金融大奖系列评选正式揭晓，博时基金董事长张光华荣膺“2016 南方金融领导力年度大奖”，博时基金基金经理魏桢荣获“2016 南方金融年度投资理财师”称号。

•由中国基金报、香山财富论坛、深圳市政府金融办、国泰基金联合主办的“中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛”2016 年 5 月 13 日在深举行。博时旗下博时信用债券获得“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。

•2016 年 5 月 10 日，由上海证券报主办的 2016 中国基金业峰会暨第十三届“金基金”奖颁奖典礼在上海举办，博时基金凭借在固定收益投资领域的突出表现，荣获“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司”大奖。

•2016 年 3 月 27 日，第十三届中国基金业金牛奖揭晓，博时基金凭借在固定收益产品出色的业绩表现摘得了基金业的“奥斯卡”奖----“固定收益投资金牛基金公司”奖。wind 数据显示，2015 年博时基金旗下 10 只纯债产品平均收益率达 12.65%，其中 6 只定期开放债基平均收益率更高达 15.17%，博时安丰 18 个月定期开放债券和博时双月薪双双夺得同类基金收益榜冠军。



•2016 年 3 月 15 日，由腾讯证券主办的《“挑战 机遇”315 评选——投资者最认同的券商、基金领军人物》评选活动日前揭晓，博时基金董事长张光华先生获评“投资者最认同的公募基金领军人物”，网络票选高居第二位。

•2016 年 1 月 18 日，大众证券报“2015 中国基金风云榜”上，博时创业成长(050014)荣获 2015“最受投资者喜爱基金”奖、博时安丰 18 个月定开债（160515）荣获 2015“最佳固定收益型基金”奖。

•2016 年 1 月 15 日，2016 年金融理财创新与发展论坛暨第六届“金貔貅”奖颁奖盛典在京举办，博时基金获评年度金牌品牌力、金牌创新力两项大奖；博时“存金宝”获年度金牌创新力金融产品奖。

#### 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		
赵云阳	基金经理	2015-10-08	-	5.8	2003 年至 2010 年在晨星中国研究中心工作。2010 年加入博时基金管理有限公司，历任量化分析师、基金经理助理、博时特许价值股票基金、博时招财一号保本基金、博时中证淘金大数据 100 基金、博时沪深 300 指数基金基金经理。现任博时深证基本面 200ETF 基金兼博时深证基本面 200ETF 联接基金、上证企债 30ETF 基金、博时证券保险指数分级基金、博时黄金 ETF 基金、博时上证 50ETF 基金、博时上证 50ETF 联接基金、博时银行分级基金、博时黄金 ETF 联接基金的基金经理。
尹浩	高级研究员兼基金经理助理	2015-09-21	-	4	2012 年 7 月至 2014 年 6 月在华宝证券工作，任研究所研究员。2014 年 7 月至 2015 年 5 月在国金证券工作，任研究所研究员。2015 年 6 月 1 日加入博时基金管理有限公司。现任指数投资部高级研究员兼基金经理助理。

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，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

2016 年上半年，宏观经济平稳运行但增速疲软，CPI 在 5 月回落到 2%。房地产略有反弹，基建投资基本持平，投资增速缓慢下行。从汇率方面来看，美联储虽未及预期加息，但受实体经济下行压力和国际市场波动对人民币汇率短期走势的冲击，人民币自四月中旬起出现阶段性贬值。“英国脱欧”的黑天鹅事件出现，导致全球避险情绪陡增，避险资产如黄金和日元出现上涨，但随着事件的演化，延迟美国加息的预期，全球新兴市场呈现喘息机会。国内政策方面，政策重心转向“供给侧改革”，导致市场预期修复，同时也预示着主动引导释放风险概率逐步上升。行情方面，经历了 1 季度快速下跌反弹的行情后，2 季度市场进入弱势横盘整理行情。行业方面出现分化，电子、食品饮料、有色金属、家用电器领涨，传媒、交通运输、建筑装饰跌幅较大。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金，为被动跟踪指数的基金。其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差，取得标的指数所代表的市场平均回报。在本报告期内我们严格按照基金合同要求，力求组合成份股紧密跟踪指数，利用量化的手段分析跟踪误差产生的原因，并在最小化交易成本的同时适时调仓，尽可能地减少跟踪误差。同时，在本报告期，我们严格按照基金合同要求，在年中指数权重及成份股变动时，尽量降低成本、减少市场冲击，逐步调整组合与目标指数的结构一致。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日, 本基金份额净值为 0.8274 元, 累计份额净值为 0.8408 元, 本基金报告期内净值增长率为-7.26%, 同期业绩基准涨幅为-7.76%。

#### 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 2016 年下半年, 从宏观经济角度来看, 在补库存的推动下国内实体经济形式有所改善。流动性方面, 在中国稳健的货币政策影响下, 总体货币仍将呈现较为宽松态势。汇率从短期看, 避险情绪趋于平复, 预计人民币未来出现大幅贬值的概率较小; 但从全球角度来看, 发达市场受“退欧”事件的影响, 中短期需要避险消化, 未来一段时间新兴市场可能会有一定的好转。在政策方面, 仍将贯彻“供给侧改革”, 改革虽对实体经济造成一定的冲击, 但预计不会对经济增速造成过大影响。继续关注有业绩支撑的食品饮料以及经济转型和供给侧改革的相关受益股票板块具备投资价值, 同时关注行业低配的医药板块、商品周期相关的波段机会、以及弹性较强的券商板块。

在投资策略上, 博时中证银行指数分级基金作为一只被动的指数基金, 在建仓期之后, 我们会以最小化跟踪误差为目标, 紧密跟踪中证银行指数, 而在建仓期内, 根据市场情形可进行灵活的仓位选择, 尽量为投资人降低损失。同时我们仍然看好中国长期的经济增长, 希望通过博时中证银行指数分级基金为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

#### 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

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 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：博时中证银行指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.3.1	7,458,143.65	8,559,976.77
结算备付金		-	13,934.25
存出保证金		5,349.64	136,952.42
交易性金融资产	6.4.3.2	121,606,348.05	150,833,890.83
其中：股票投资		121,606,348.05	150,833,890.83
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	1,494.54	1,926.17
应收股利		-	-
应收申购款		8,131.86	66,219.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>129,079,467.74</b>	<b>159,612,899.58</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	339.64
应付赎回款		67,494.47	267,328.01
应付管理人报酬		106,087.08	136,503.86
应付托管费		23,339.14	30,030.86
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	29,210.38	43,877.89
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	349,075.98	141,007.45
<b>负债合计</b>		<b>575,207.05</b>	<b>619,087.71</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.3.9	152,827,432.74	175,364,868.37
未分配利润	6.4.3.10	-24,323,172.05	-16,371,056.50
<b>所有者权益合计</b>		<b>128,504,260.69</b>	<b>158,993,811.87</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>129,079,467.74</b>	<b>159,612,899.58</b>



注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8274 元，基金份额总额 155,306,235.48 份（其中母基金基金份额净值 0.8274 元，基金份额总额 115,210,179.48 份；A 类基金份额净值 1.0290 元，基金份额总额 20,048,028.00 份；B 类基金份额净值 0.6258 元，基金份额总额 20,048,028.00 份）。

## 6.2 利润表

会计主体：博时中证银行指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 9 日（基 金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-10,490,010.61</b>	<b>-2,873,634.26</b>
1. 利息收入		28,107.21	83,011.68
其中：存款利息收入	6.4.3.11	28,107.21	83,011.68
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,484,718.63	944,532.42
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-3,430,837.08	-389,696.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	1,946,118.45	1,334,228.93
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-9,073,579.90	-3,951,666.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	40,180.71	50,488.10
<b>减：二、费用</b>		<b>1,179,662.05</b>	<b>619,288.89</b>
1. 管理人报酬		680,661.00	178,106.92
2. 托管费		149,745.38	39,183.52
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	48,666.39	358,181.11
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.19	300,589.28	43,817.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-11,669,672.66</b>	<b>-3,492,923.15</b>
减：所得税费用		-	-

四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-11,669,672.66	-3,492,923.15
-------------------	--	----------------	---------------

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时中证银行指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	175,364,868.37	-16,371,056.50	158,993,811.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,669,672.66	-11,669,672.66
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）	-22,537,435.63	3,717,557.11	-18,819,878.52
其中：1. 基金申购款	16,536,421.41	-2,851,958.75	13,684,462.66
2. 基金赎回款	-39,073,857.04	6,569,515.86	-32,504,341.18
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	152,827,432.74	-24,323,172.05	128,504,260.69
项目	上年度可比期间 2015 年 6 月 9 日（基金合同生效日）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）	287,168,470.70	-	287,168,470.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,492,923.15	-3,492,923.15
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）	54,236,083.29	-290,988.78	53,945,094.51
其中：1. 基金申购款	95,080,906.50	-1,192,735.88	93,888,170.62
2. 基金赎回款	-40,844,823.21	901,747.10	-39,943,076.11
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	341,404,553.99	-3,783,911.93	337,620,642.06



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      主管会计工作负责人：王德英      会计机构负责人：成江

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

### 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》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：及其他相关财税法规和实务操作，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。基金买卖股票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，包括买卖股票的差价收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	7,458,143.65
定期存款	-
其他存款	-
合计	7,458,143.65

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	143,301,170.15	121,606,348.05	-21,694,822.10
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	143,301,170.15	121,606,348.05	-21,694,822.10

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,492.14
其他	2.40
合计	1,494.54

#### 6.4.3.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	29,210.38

银行间市场应付交易费用	-
合计	29,210.38

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付赎回费	171.82
其他应付款	100,000.00
预提费用	248,904.16
合计	349,075.98

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	178,209,105.70	175,364,868.37
本期申购	16,804,603.64	16,536,421.41
本期赎回（以“-”号填列）	-39,707,473.86	-39,073,857.04
基金份额折算净增加额	-	-
本期末	155,306,235.48	152,827,432.74

注：1. 本基金的基金份额包括博时银行份额、博时银行 A 份额和博时银行 B 份额。本期申购含申购的博时银行份额和配对转入的博时银行 A 份额和博时银行 B 份额，本期赎回含赎回的博时银行份额和配对转出的博时银行 A 份额和博时银行 B 份额。

2. 截至 2016 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 40,096,056.00（其中博时银行 A 份额 20,048,028.00 份，博时银行 B 份额 20,048,028.00 份），托管在场内未上市交易的基金份额为 1,766,606.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 113,443,573.48 份，均为博时银行份额。场内的博时银行份额登记在证券登记结算系统，场外的博时银行份额登记在注册登记系统，可按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-10,321,121.88	-6,049,934.62	-16,371,056.50
本期利润	-2,596,092.76	-9,073,579.90	-11,669,672.66
本期基金份额交易产生的变动数	1,610,664.78	2,106,892.33	3,717,557.11
其中：基金申购款	-1,132,713.42	-1,719,245.33	-2,851,958.75
基金赎回款	2,743,378.20	3,826,137.66	6,569,515.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,306,549.86	-13,016,622.19	-24,323,172.05

### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	27,875.00
结算备付金利息收入	141.50
其他	90.71
合计	28,107.21

### 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	22,262,823.41
减：卖出股票成本总额	25,693,660.49
买卖股票差价收入	-3,430,837.08

### 6.4.3.13 债券投资收益

无发生额。

### 6.4.3.14 衍生工具收益

无发生额。

### 6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,946,118.45
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,946,118.45

### 6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-9,073,579.90
——股票投资	-9,073,579.90
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

3. 其他	-
合计	-9, 073, 579. 90

#### 6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	40, 180. 71
合计	40, 180. 71

#### 6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	48, 666. 39
银行间市场交易费用	-
合计	48, 666. 39

#### 6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	19, 890. 78
信息披露费	149, 178. 12
银行汇划费	1, 685. 12
上市费	29, 835. 26
指数使用费	100, 000. 00
合计	300, 589. 28

### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.4.1 或有事项

无。

#### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

### 6.4.5 关联方关系

#### 6.4.5.1 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。

#### 6.4.5.2 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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 6.4.6.2 关联方报酬

###### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年6月9日（基金合同 生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	680,661.00	178,106.92
其中：支付销售机构的客户维护费	205,440.71	37,232.87

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 1.00% 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 × 1.00% / 当年天数。

###### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年6月9日（基金合同 生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	149,745.38	39,183.52

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22% 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 × 0.22% / 当年天数

##### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

##### 6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

###### 6.4.6.4.2 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。

##### 6.4.6.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年6月9日（基金合同生效日）至2015 年6月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	7,458,143.65	27,875.00	21,438,164.32	83,008.40

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有 593,700.00 股托管人公司中国建设银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 3,093,871.63 元，估值总额为人民币 2,820,075.00 元，占基金资产净值的比例为 2.1945%。

#### 6.4.7 利润分配情况

无。

#### 6.4.8 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动跟踪指数的股票型指数证券投资基金，属于证券投资基金当中较高预期风险、较高预期收益的品种。一般情形下，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。就三级基金份额而言，博时银行份额为常规指数基金份额，具有预期风险较高、预期收益较高的特征；博时银行 A 份额具有低风险、预期收益相对稳定的特征；博时银行 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程



序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。跟踪指数为本基金的目标，力求将基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以下、年跟踪误差控制在 4% 以下。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的、由执行总裁和风险控制委员会、督察长、监察法律部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；督察长独立行使权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察法律部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察法律部对公司执行总裁负责。

本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析互相补充的方法，在股票、债券和现金等资产类之间进行相对稳定的适度配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。

#### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市

场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.8 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

**6.4.9.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	7,458,143.65	-	-	-	7,458,143.65
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	5,349.64	-	-	-	5,349.64
交易性金融资产	-	-	-	121,606,348.05	121,606,348.05
应收利息	-	-	-	1,494.54	1,494.54
应收申购款	-	-	-	8,131.86	8,131.86
<b>资产总计</b>	<b>7,463,493.29</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>121,615,974.45</b>	<b>129,079,467.74</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	67,494.47	67,494.47
应付管理人报酬	-	-	-	106,087.08	106,087.08
应付托管费	-	-	-	23,339.14	23,339.14
应付交易费用	-	-	-	29,210.38	29,210.38
其他负债	-	-	-	349,075.98	349,075.98
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>575,207.05</b>	<b>575,207.05</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>7,463,493.29</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>121,040,767.40</b>	<b>128,504,260.69</b>
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	8,559,976.77	-	-	-	8,559,976.77
结算备付金	13,934.25	-	-	-	13,934.25
存出保证金	136,952.42	-	-	-	136,952.42
交易性金融资产	-	-	-	150,833,890.83	150,833,890.83
应收利息	-	-	-	1,926.17	1,926.17
应收申购款	-	-	-	66,219.14	66,219.14
<b>资产总计</b>	<b>8,710,863.44</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>150,902,036.14</b>	<b>159,612,899.58</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	339.64	339.64
应付赎回款	-	-	-	267,328.01	267,328.01
应付管理人报酬	-	-	-	136,503.86	136,503.86
应付托管费	-	-	-	30,030.86	30,030.86
应付交易费用	-	-	-	43,877.89	43,877.89
其他负债	-	-	-	141,007.45	141,007.45
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>619,087.71</b>	<b>619,087.71</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>8,710,863.44</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>150,282,948.43</b>	<b>158,993,811.87</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 06 月 30 日，本基金未持有的交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析互相补充的方法，在股票、债券和现金等资产类之间进行相对稳定的适度配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票资产占基金资产的比例为 90%~95%；债券、货币市场工具、现金、权证、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具及其他资产占基金资产的 5%~10%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	121,606,348.05	94.63	150,833,890.83	94.87
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	121,606,348.05	94.63	150,833,890.83	94.87
----	----------------	-------	----------------	-------

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
		1. 中证银行指数上升 5%	增加约 623
2. 中证银行指数下降 5%	减少约 623	减少约 763	

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 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 2016 年 6 月 30 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一层次的余额为 121,606,348.05 元，无属于第二层次和第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 150,833,890.83 元，无属于第二层次和第三层次的余额）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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。

## § 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	权益投资	121,606,348.05	94.21
	其中：股票	121,606,348.05	94.21
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	7,458,143.65	5.78
7	其他各项资产	14,976.04	0.01
8	合计	129,079,467.74	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	-	-
J	金融业	121,606,348.05	94.63
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	121,606,348.05	94.63

### 7.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	1,826,900	16,314,217.00	12.70
2	601166	兴业银行	1,032,400	15,733,776.00	12.24
3	600036	招商银行	801,059	14,018,532.50	10.91
4	601328	交通银行	2,075,500	11,685,065.00	9.09
5	600000	浦发银行	674,175	10,496,904.75	8.17
6	601288	农业银行	2,966,600	9,493,120.00	7.39
7	601169	北京银行	793,940	8,233,157.80	6.41
8	601398	工商银行	1,772,900	7,871,676.00	6.13
9	601988	中国银行	1,635,400	5,249,634.00	4.09
10	601818	光大银行	1,238,600	4,657,136.00	3.62
11	000001	平安银行	534,360	4,648,932.00	3.62
12	600015	华夏银行	416,220	4,116,415.80	3.20
13	601939	XD 建设银	593,700	2,820,075.00	2.19
14	601009	南京银行	282,740	2,654,928.60	2.07
15	002142	宁波银行	152,520	2,254,245.60	1.75
16	601998	中信银行	239,600	1,358,532.00	1.06

#### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601328	交通银行	1,679,861.00	1.06



2	601398	工商银行	676,852.00	0.43
3	601166	兴业银行	515,482.00	0.32
4	601939	建设银行	445,819.00	0.28
5	600000	浦发银行	383,206.94	0.24
6	600036	招商银行	360,484.00	0.23
7	601288	农业银行	322,389.00	0.20
8	601169	北京银行	280,927.67	0.18
9	601818	光大银行	179,944.00	0.11
10	601988	中国银行	172,659.00	0.11
11	000001	平安银行	148,071.00	0.09
12	600015	华夏银行	143,636.00	0.09
13	601009	南京银行	98,195.00	0.06
14	002142	宁波银行	72,219.00	0.05
15	601998	中信银行	58,131.00	0.04
16	600016	民生银行	1,821.00	0.00

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	6,290,144.95	3.96
2	600000	浦发银行	3,688,890.71	2.32
3	601166	兴业银行	2,227,223.00	1.40
4	600036	招商银行	1,736,513.00	1.09
5	601328	交通银行	1,316,825.00	0.83
6	601288	农业银行	1,262,541.00	0.79
7	601169	北京银行	1,030,224.00	0.65
8	601398	工商银行	949,795.00	0.60
9	601988	中国银行	736,265.00	0.46
10	601818	光大银行	632,121.00	0.40
11	000001	平安银行	614,978.00	0.39
12	600015	华夏银行	555,802.80	0.35
13	601009	南京银行	358,124.00	0.23
14	601939	建设银行	348,767.00	0.22
15	002142	宁波银行	266,829.00	0.17
16	601998	中信银行	247,779.95	0.16

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	5,539,697.61
卖出股票的收入（成交）总额	22,262,823.41

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填

列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 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。

### 7.11 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持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 报告期内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。

#### 7.12.3 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	5,349.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,494.54
5	应收申购款	8,131.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,976.04

#### 7.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 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。

## § 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
博时银行	3,890	29,617.01	151,277.00	0.13%	115,058,902.48	99.87%
银行 A 类	190	105,515.94	8,338,731.00	41.59%	11,709,297.00	58.41%
银行 B 类	514	39,003.95	469,871.00	2.34%	19,578,157.00	97.66%
合计	4,594	33,806.32	8,959,879.00	5.77%	146,346,356.48	94.23%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

银行 A 级：

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	中国人民财产保险股份有限公司—自有资金	3,936,431.00	19.64%
2	工银安盛人寿保险有限公司	3,922,190.00	19.56%
3	郑天才	1,000,068.00	4.99%
4	张凤国	944,015.00	4.71%
5	王晓娟	503,009.00	2.51%
6	于鸿立	500,015.00	2.49%
7	贝惠玲	500,015.00	2.49%
8	刘京红	500,014.00	2.49%
9	丁波	500,009.00	2.49%
10	费伟伟	342,510.00	1.71%

银行 B 级：

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	彭晓强	2,733,134.00	13.63%
2	郑天才	1,000,068.00	4.99%
3	丁波	510,010.00	2.54%
4	王晓娟	503,010.00	2.51%
5	刘景如	400,000.00	2.00%
6	赵冬	366,700.00	1.83%
7	广州万宝长睿投资有限公司	352,527.00	1.76%
8	薛锋	311,140.00	1.55%
9	赵平	300,020.00	1.50%
10	邵滢	300,005.00	1.50%

### 8.3 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
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	博时银行	19,883.76	0.02%
	银行 A 级	-	-
	银行 B 级	-	-
	合计	19,883.76	0.01%

### 8.4 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	博时银行	-
	银行 A 级	-
	银行 B 级	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时银行	-
	银行 A 级	-
	银行 B 级	-
	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	博时银行	银行 A 类	银行 B 类
基金合同生效日（2015 年 6 月 9 日）基金份额总额	146,591,994.70	70,288,238.00	70,288,238.00
本报告期期初基金份额总额	124,676,379.70	26,766,363.00	26,766,363.00
本报告期基金总申购份额	16,804,603.64	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	39,707,473.86	-	-
本报告期基金拆分变动份额	13,436,670.00	-6,718,335.00	-6,718,335.00
本报告期期末基金份额总额	115,210,179.48	20,048,028.00	20,048,028.00

## § 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

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

### 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

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。

### 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	
中信证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
浙商证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
高华证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	13,593,415.18	48.89%	12,658.21	52.90%	新增 1 个
华福证券	1	7,244,102.02	26.06%	5,298.55	22.14%	新增 1 个
长江证券	1	3,682,515.88	13.25%	3,428.27	14.33%	-
安信证券	1	2,335,247.94	8.40%	1,705.71	7.13%	新增 1 个
中金公司	1	717,668.00	2.58%	668.20	2.79%	-
华创证券	2	229,572.00	0.83%	167.95	0.70%	-

#### 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

无。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时中证银行指数分级证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-20
2	关于博时旗下部分开放式基金增加诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-22
3	关于博时旗下部分开放式基金增加海银基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-25
4	博时中证银行指数分级证券投资基金 2015 年年度报告(摘要)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-26
5	博时中证银行指数分级证券投资基金 2015 年年度报告(正文)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-26
6	关于博时旗下部分开放式基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-28
7	关于博时旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-04-01
8	博时中证银行指数分级证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-04-22
9	关于博时旗下部分开放式基金增加大连网金金融信息服务有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-06
10	关于博时旗下部分开放式基金增加珠海盈米财富管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-26
11	博时基金管理有限公司关于调整旗下部分基金的申购、定投、最低持有数量限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-08
12	关于博时旗下部分开放式基金增加大泰金石投资管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-24
13	关于博时旗下部分基金继续参加交通银行网上及手机银行申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-30

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

11.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时中证银行指数分级证券投资基金募集的文

件；

11.1.2 《博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同》；

11.1.3 《博时中证银行指数分级证券投资基金托管协议》；

11.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

11.1.5 报告期内博时中证银行指数分级证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿；

## 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

## 11.3 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

博时基金管理有限公司  
二〇一六年八月二十五日