

# 博时中证银行指数分级证券投资基金

## 2016 年半年度报告摘要

### 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

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 2016 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

## 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	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

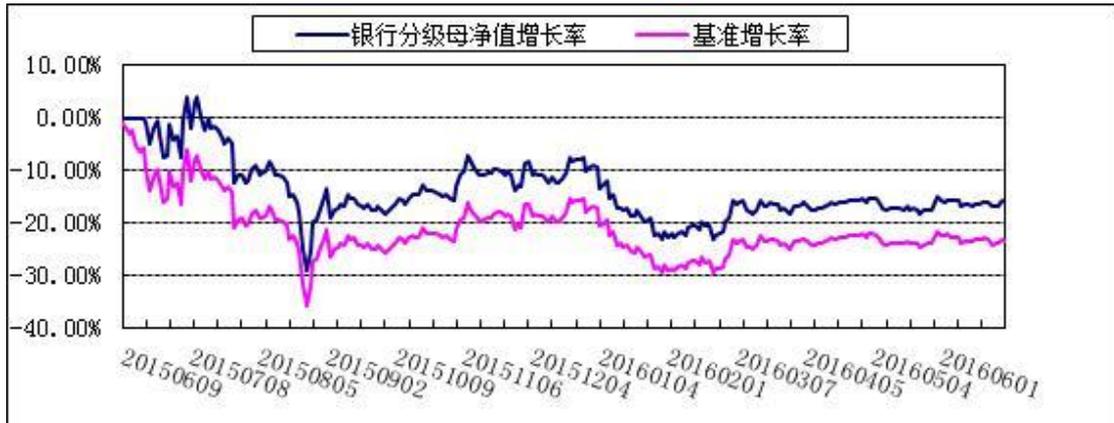
## 3.2 基金净值表现

### 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遵规守信情况的说明

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的真实、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	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>	-	-
银行存款	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	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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	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	-	-
<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>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	-	-
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	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	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	152,827,432.74	175,364,868.37
未分配利润	-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	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	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	-3,430,837.08	-389,696.51
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	1,946,118.45	1,334,228.93
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-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）	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	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	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	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-11,669,672.66</b>	<b>-3,492,923.15</b>

### 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：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 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、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。

#### 6.4.4 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 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。

###### 6.4.4.2.2 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

##### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

##### 6.4.4.4 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 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。

#### 6.4.4.6 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

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%。

#### 6.4.5 期末（2016 年 6 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

无。

###### 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.6 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前十名股票投资明细

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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于博时基金管理有限公司网站的年度报告正文。

### 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前五名股票投资明细

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 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。

博时基金管理有限公司  
二〇一六年八月二十五日