

# 博时亚洲票息收益债券型证券投资基金

## 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十五日

## 1 重要提示

### 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。

基金托管人招商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	博时亚洲票息收益债券（QDII）
基金主代码	050030
交易代码	050030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年2月1日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,689,482,866.17 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过分析亚洲区域各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面，寻找各类债券的投资机会，在谨慎投资的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	主要投资于亚洲市场的各类债券，以买入持有策略为主，配合信用策略、期限结构策略、互换策略等卫星策略。在谨慎投资的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return
风险收益特征	中等风险/收益的开放式基金

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	张燕
	联系电话	0755-83169999	0755-83199084
	电子邮箱	service@bosera.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	95555
传真		0755-83195140	0755-83195201

### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Brown Brothers Harriman Co.
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		-	140 Broadway New York, NY 10005

邮政编码	-	-
------	---	---

## 2.5 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、基金托管人处

## 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	62,019,004.82
本期利润	129,062,183.90
加权平均基金份额本期利润	0.0770
本期基金份额净值增长率	7.18%
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	0.0687
期末基金资产净值	2,016,367,998.98
期末基金份额净值	1.1935

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。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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	1.89%	0.33%	2.58%	0.35%	-0.69%	-0.02%
过去三个月	5.35%	0.29%	5.59%	0.29%	-0.24%	-
过去六个月	7.18%	0.26%	8.80%	0.26%	-1.62%	-
过去一年	16.33%	0.31%	16.47%	0.29%	-0.14%	0.02%
过去三年	38.79%	0.24%	31.01%	0.23%	7.78%	0.01%
自基金合同生效起至今	36.13%	0.24%	24.22%	0.25%	11.91%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为：JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return

### 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



注：本基金的基金合同于 2013 年 2 月 1 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六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第 12 条“三、投资范围”、“五、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 7.18%，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		
何凯	基金经理/ 固定收益 总部国际 组投资总 监	2014-04-02	-	9.9	2006年起先后在荷兰银行（伦敦），中国投资有限责任公司、南方东英资产管理有限公司从事投资研究工作。2012年加入博时基金管理有限公司，历任国际投资部副总经理、基金经理助理、固定收益总部国际组投资副总监。现任固定收益总部国际组投资总监兼博时亚洲票息

					收益债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

#### 4.3 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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

##### 4.4.2 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。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，受美国加息预期下降，英国脱欧等事件影响，美国国债利率震荡下行。全球流动性继续宽松，全球股市、大宗商品及债券市场在经历了年初的短暂调整后持续上扬。中国方面，人民币弱势走低。

受益于美国国债利率的下行以及信用利差的收窄，亚洲债券市场上半年获得了可观的回报。其中高收益债券表现优于投资级。从区域上看，去年跌幅较大的印尼领跑，而中资债券表现则低于平均水平。



在基金的操作上，我们虽有所分散化，增加了非中国的配置，但由于总体仍超配中国，且低配久期，表现弱于基准。

#### 4.5.2 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 1.1935 元，累计份额净值为 1.3360 元，报告期内净值增长率为 7.18%，同期业绩基准涨幅为 8.80%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为美联储加息进程将是缓慢可控的，且欧洲、日本等发达经济体货币政策总体仍然宽松。全球债券市场已有大量资产处于负利率状态。在此环境下，资金对于收益的追逐或仍将利好部分基本面有支撑的新兴市场。中国宏观政策的持续放松也会对债券市场形成支持。中资海外债券在基本面以及技术面的双重支撑下未来会有较为稳健的回报，与此同时其他市场中一些结构性或者个券层面的机会值得更多关注。本基金将在稳定票息和信用质量的基础上积极把握配置机会和寻求交易性机会，力争创造超额收益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内共进行 1 次分红，以 2015 年 12 月 31 日可分配利润为基准，博时亚洲票息收益债券(QDII)人民币每 10 份分红 0.600 元；博时亚洲票息收益债券(QDII)美元钞每 1 份分红 0.092 美元；博时亚洲票息收益债券(QDII)美元汇每 10 份分红 0.092 美元。

### 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华

《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，博时亚洲票息收益债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 103,550,852.36 元。

### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，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：博时亚洲票息收益债券型证券投资基金

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	158,640,548.62	154,412,788.44
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,876,893,316.46	1,233,476,567.73
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,876,893,316.46	1,233,476,567.73
资产支持证券投资	-	-
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	34,707,435.80	23,882,213.50
应收股利	-	-
应收申购款	1,808,275.11	45,383,829.36
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>2,072,049,575.99</b>	<b>1,457,155,399.03</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	41,511,696.28	37,439,659.77
应付赎回款	12,135,785.55	3,717,624.60
应付管理人报酬	1,300,421.92	870,010.97
应付托管费	406,381.84	271,878.42
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	327,291.42	200,479.12
<b>负债合计</b>	<b>55,681,577.01</b>	<b>42,499,652.88</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	1,689,482,866.17	1,206,292,035.11
未分配利润	326,885,132.81	208,363,711.04
<b>所有者权益合计</b>	<b>2,016,367,998.98</b>	<b>1,414,655,746.15</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>2,072,049,575.99</b>	<b>1,457,155,399.03</b>

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1935 元，基金份额总额 1,689,482,866.17 份

## 6.2 利润表

会计主体：博时亚洲票息收益债券型证券投资基金

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 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	<b>139,319,047.69</b>	<b>42,666,971.72</b>
1.利息收入	64,856,587.83	34,508,975.15
其中：存款利息收入	45,924.69	44,416.75
债券利息收入	64,810,663.14	34,395,237.96
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	69,320.44
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	5,377,589.17	-12,796,875.10
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	0.00	-
债券投资收益	5,377,589.17	-12,898,750.05
资产支持证券投资	-	-

衍生工具收益	-	-
股利收益	-	101,874.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	67,043,179.08	16,557,453.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	781,518.63	2,101,655.49
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,260,172.98	2,295,762.78
<b>减：二、费用</b>	<b>10,256,863.79</b>	<b>4,888,521.77</b>
1. 管理人报酬	7,605,463.06	3,537,426.64
2. 托管费	2,376,707.18	1,105,445.80
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	-	18,343.20
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	274,693.55	227,306.13
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>129,062,183.90</b>	<b>37,778,449.95</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>129,062,183.90</b>	<b>37,778,449.95</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时亚洲票息收益债券型证券投资基金

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）	1,206,292,035.11	208,363,711.04	1,414,655,746.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	129,062,183.90	129,062,183.90
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）	483,190,831.06	93,010,090.23	576,200,921.29
其中：1.基金申购款	590,029,593.81	108,107,898.84	698,137,492.65
2.基金赎回款	-106,838,762.75	-15,097,808.61	-121,936,571.36
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）	-	-103,550,852.36	-103,550,852.36
五、期末所有者权益（基金净值）	1,689,482,866.17	326,885,132.81	2,016,367,998.98
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	880,254,016.79	67,353,516.51	947,607,533.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	37,778,449.95	37,778,449.95
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）	-78,372,066.58	-4,493,997.12	-82,866,063.70
其中：1.基金申购款	204,101,103.47	10,945,030.87	215,046,134.34
2.基金赎回款	-282,473,170.05	-15,439,027.99	-297,912,198.04
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）	-	-36,134,979.57	-36,134,979.57
五、期末所有者权益（基金净值）	801,881,950.21	64,502,989.77	866,384,939.98

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 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。

### 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》及其他境内外相关税务法规和实务操作，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。
- (2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。
- (3) 目前基金取得的源自境外的债券利息收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

### 6.4.3 关联方关系

#### 6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司(“博时基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
布朗兄弟哈里曼银行(“布朗兄弟哈里曼”)	境外资产托管人
招商证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中国长城资产管理公司	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
招商证券(香港)有限公司(“招商香港”)	基金管理人的股东招商证券的子公司
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。

#### 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,605,463.06	3,537,426.64
其中：支付销售机构的客户维护费	499,821.61	1,579,824.74

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 0.80% 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 X 0.80% / 当年天数。

###### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,376,707.18	1,105,445.80

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 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自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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1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
招商银行	20,096,249.00	45,924.69	34,742,828.34	42,801.24
布朗兄弟哈里曼	138,544,299.62	-	31,080,509.72	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人招商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.5 期末（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。

## 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	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,876,893,316.46	90.58
	其中：债券	1,876,893,316.46	90.58
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-



7	银行存款和结算备付金合计	158,640,548.62	7.66
8	其他各项资产	36,515,710.91	1.76
9	合计	2,072,049,575.99	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有权益投资。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有权益投资。

## 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名的权益投资明细

本基金本报告期末未进行权益资产的投资。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

本基金本报告期末未进行权益资产的投资。

### 7.4.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

本基金本报告期末未进行权益资产的投资。

## 7.5 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
BBB-	66,768,889.68	3.31
BB+	44,073,673.99	2.19
BB	267,303,217.37	13.26
BB-	150,951,567.58	7.49
B+	409,096,569.25	20.29
B	348,419,855.15	17.28
B-	161,051,490.22	7.99
未评级	429,228,053.22	21.29

注：评级机构为标准普尔。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比
----	------	------	----	------	----------

					例 (%)
1	XS1241497384	CHINSC 10 07/02/20	120,000	88,621,213.54	4.40
2	XS1086808570	FUTLAN 10 1/4 07/21/19	100,000	73,363,618.08	3.64
3	XS1160444391	CIFIHG 7 3/4 06/05/20	100,000	71,463,116.16	3.54
4	XS1055092602	KINSF 1 1/4 04/11/19	850,000	71,148,969.89	3.53
5	USG24524AH6 7	COGARD 7 1/4 04/04/21	100,000	70,773,471.36	3.51

注：债券代码为 ISIN 码。

#### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

#### 7.10 投资组合报告附注

**7.10.1** 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。

**7.10.2** 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。

#### 7.10.3 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	应收股利	-
4	应收利息	34,707,435.80
5	应收申购款	1,808,275.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,515,710.91

#### 7.10.4 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。

#### 7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.10.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

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

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
10,841	155,841.98	247,671,212.13	14.66%	1,441,811,654.04	85.34%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,198,931.56	0.07%

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：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

基金合同生效日（2013年2月1日）基金份额总额	1,790,533,225.99
--------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	1,206,292,035.11
本报告期基金总申购份额	590,029,593.81
减：本报告期基金总赎回份额	106,838,762.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,689,482,866.17

## 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

无。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	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
Barclays Bank PLC.	85,643,258.86	7.38%	-	-
BNP Paribus Bank	150,416,254.60	12.95%	-	-
BOCI Securities Ltd.	27,344,979.88	2.35%	-	-
Citigroup Global	186,470,094.08	8.95%	-	-

Markets Inc.				
CITIC Securities International Company Ltd.	11,644,205.69	1.00%	-	-
Credit Suisse Securities Ltd.	16,162,818.00	1.39%	-	-
Deutsche Bank	10,148,107.00	0.87%	-	-
Development Bank of Singapore	985,000.00	0.08%	-	-
Goldman Sachs International	89,112,984.81	7.67%	-	-
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	85,576,703.00	7.37%	-	-
HUATAI Securities Ltd	45,269,020.13	3.90%	-	-
Haitong International Securities Company Limited	68,830,608.06	5.93%	-	-
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Ltd.	55,716,765.57	4.80%	-	-
JP Morgan Securities PLC	18,652,130.96	1.61%	-	-
Bank of America Merrill Lynch	134,782,500.15	11.61%	-	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	52,162,085.45	4.49%	-	-
UBS Limited	1,105,737.30	0.10%	-	-
KGI Securities (Hong Kong) Limited	7,200,919.32	0.62%	-	-

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，在多家券商开立了券商交易账户。

1、基金券商交易账户的选择标准如下：

- (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、个股分析的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。

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、基金券商交易账户的选择程序如下：

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构；

(2)基金管理人在被选中的证券经营机构开立交易账户。

**博时基金管理有限公司**

**二〇一六年八月二十五日**