

# 博时新财富混合型证券投资基金

## 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：中国工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

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。

基金托管人中国工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	博时新财富混合
基金主代码	001429
交易代码	001429
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 24 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,126,208,829.53 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期持续稳定的投资回报。
投资策略	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。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）+3%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中等收益/风险特征的基金。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	赵会军
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798

## § 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	12,186,477.21
本期利润	12,664,308.22
加权平均基金份额本期利润	0.0111
本期基金份额净值增长率	1.07%
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	0.0374
期末基金资产净值	1,168,364,818.59
期末基金份额净值	1.037

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。

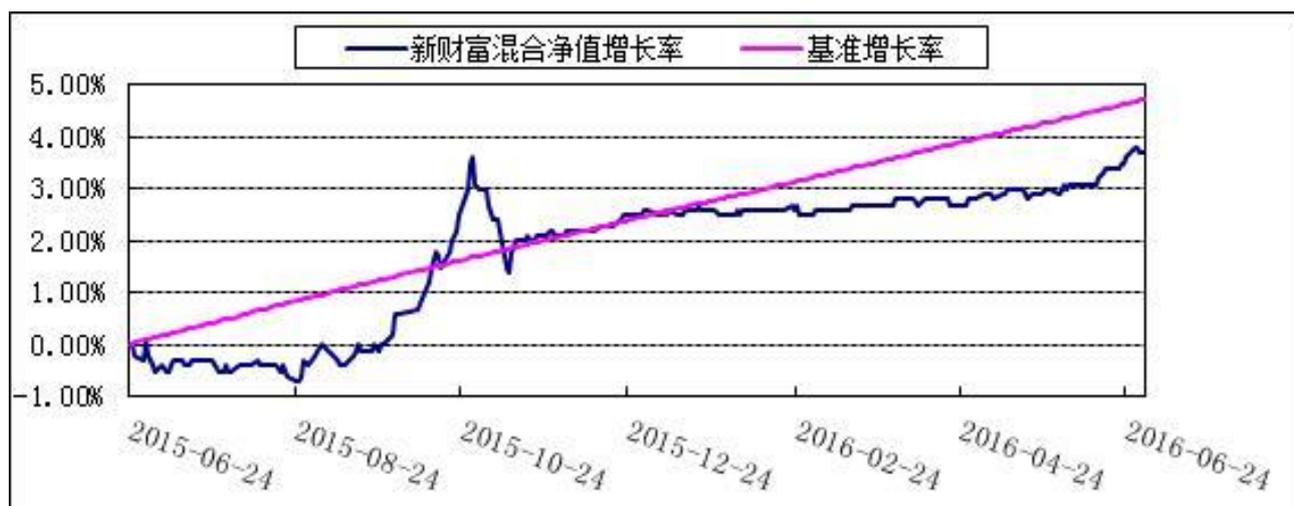
### 3.2 基金净值表现

#### 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	0.68%	0.08%	0.37%	0.01%	0.31%	0.07%
过去三个月	0.88%	0.07%	1.12%	0.01%	-0.24%	0.06%
过去六个月	1.07%	0.06%	2.24%	0.01%	-1.17%	0.05%
过去一年	3.60%	0.13%	4.62%	0.01%	-1.02%	0.12%
自基金合同生效起至今	3.70%	0.13%	4.72%	0.01%	-1.02%	0.12%

注：一年期银行定期存款利率（税后）+3%。

#### 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



## § 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		
王申	基金经理/固定收益总部研究组投资总监	2015-06-24	-	6.5	2002 年起先后在友邦保险、申银万国证券、国金证券工作。2013 年加入博时基金管理有限公司，历任固定收益研究主管、固定收益总部研究组副总监。现任固定收益总部研究组总监兼博时宏观回报债券基金、博时新财富混合基金的基金经理
过钧	基金经理/董事总经理/固定收益总部公募基金组投资总监	2015-06-24	-	15	1995 年起先后在上海工艺品进出口公司、德国德累斯顿银行上海分行、美国 Lowes 食品有限公司、美国通用电气公司、华夏基金固定收益部工作。2005 年加入博时基金管理有限公司，历任基金经理、博时稳定价值债券投资基金的基金经理、固定收益部副总经理、博时转债增强债券型证券投资基金、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金、博时裕祥分级债券型证券投资基金、博时双债增强债券型证券投资基金的基金经理。现任董事总经理兼固定收益总部公募基金组投资总监、博时信用债券投资基金、博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）、博时新财富混合型证券投资基金、博时新收益灵活配置混合型证券投资基金、博时新机遇混合型证券投资基金、博时新价值灵

					活配置混合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。

博时基金管理有限公司于 2016 年 7 月 6 日发布公告称，过钧先生不再担任本基金的基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 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

在经历了 1-4 月的类滞胀之后，随着宏观调控政策自 5 月开始再度降低对实际增速的托底要求，宏观格局再度向偏通缩的方向演绎。表现在价格信号上，前 4 个月受到价格信号驱动的广谱资产普遍出现明显回落，包括大宗商品、权益市场中的价格驱动类标的、以及无风险收益率水平。6 月下旬英国的公投退欧完全超出市场预期，短期进一步放大了这一趋势，全球风险偏好的回落比较明显。

##### 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 1.037 元，累计份额净值为 1.037 元，报告期内净值增长率为 1.07%，同期业绩基准涨幅为 2.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于对权益市场是否筑底存在不确定性、以及对于收益率回落较为确定的把握，组合在 2 季度重点参与了长端收益率回落的交易机会并有一定的收获。展望下半年，重点工作在于 2 点：1) 灵活把握长端利率品种的交易博弈；2) 观察权益市场整体的定位，在出现大概率绝对收益机会时参与，但除非出现明显的底部特征，否则依旧不会以高仓位配置的视角来对待

权益类资产。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在对博时新财富混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，博时新财富混合型证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博

时新财富混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时新财富混合型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：博时新财富混合型证券投资基金

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	1,031,024,200.64	12,202,185.59
结算备付金	9,100,952.38	112,315.80
存出保证金	10,267.07	14,368.75
交易性金融资产	109,815,932.24	79,849,986.81
其中：股票投资	6,969,932.24	29,754,986.81
基金投资	-	-
债券投资	102,846,000.00	50,095,000.00
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	-	760,000,000.00
应收证券清算款	19,794,197.94	341,819,308.44
应收利息	425,521.88	628,653.98
应收股利	-	-
应收申购款	24,307.17	228,678.22
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>1,170,195,379.32</b>	<b>1,194,855,497.59</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	-	-
应付赎回款	160,576.04	1,327,898.52
应付管理人报酬	1,146,453.33	1,225,142.51
应付托管费	238,844.44	255,238.01
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	48,209.36	26,959.78
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	236,477.56	126,668.22
<b>负债合计</b>	<b>1,830,560.73</b>	<b>2,961,907.04</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	1,126,208,829.53	1,161,434,848.37
未分配利润	42,155,989.06	30,458,742.18
<b>所有者权益合计</b>	<b>1,168,364,818.59</b>	<b>1,191,893,590.55</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>1,170,195,379.32</b>	<b>1,194,855,497.59</b>

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.037 元，基金份额总额 1,126,208,829.53 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时新财富混合型证券投资基金

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	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 24 日（基金合同 生效日）至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>21,864,227.27</b>	<b>469,367.54</b>
1. 利息收入		10,202,140.28	63,957.03
其中：存款利息收入	6.4.3.11	1,840,992.64	57,058.87
债券利息收入		5,201,854.55	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,159,293.09	6,898.16
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,117,099.40	-
其中：股票投资收益	6.4.3.12	5,097,441.44	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	5,773,544.57	-
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	246,113.39	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	477,831.01	393,922.90
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	67,156.58	11,487.61
<b>减：二、费用</b>		<b>9,199,919.05</b>	<b>87,605.32</b>
1. 管理人报酬		7,003,932.63	51,456.56
2. 托管费		1,459,152.68	10,720.12

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	89,992.77	17,549.02
5. 利息支出		378,267.61	-
其中：卖出回购金融资产支出		378,267.61	-
6. 其他费用	6.4.3.19	268,573.36	7,879.62
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>12,664,308.22</b>	<b>381,762.22</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>12,664,308.22</b>	<b>381,762.22</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时新财富混合型证券投资基金

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）	1,161,434,848.37	30,458,742.18	1,191,893,590.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,664,308.22	12,664,308.22
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）	-35,226,018.84	-967,061.34	-36,193,080.18
其中：1. 基金申购款	1,205,622.27	32,688.81	1,238,311.08
2. 基金赎回款	-36,431,641.11	-999,750.15	-37,431,391.26
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）	1,126,208,829.53	42,155,989.06	1,168,364,818.59
项目	上年度可比期间 2015 年 6 月 24 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）	260,914,518.62	-	260,914,518.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	35,389,610.40	35,389,610.40
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）	900,520,329.75	-4,930,868.22	895,589,461.53
其中：1. 基金申购款	1,063,933,874.84	-4,199,404.17	1,059,734,470.67
2. 基金赎回款	-163,413,545.09	-731,464.05	-164,145,009.14
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)	1,161,434,848.37	30,458,742.18	1,191,893,590.55

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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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》及其他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) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

(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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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

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

##### 6.4.4.1.1 股票交易

无。

##### 6.4.4.1.2 权证交易

无。

##### 6.4.4.1.3 债券交易

无。

##### 6.4.4.1.4 债券回购交易

无。

##### 6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	18,535.66	48.78%	18,535.66	67.60%
关联方名称	上年度可比期间 2015年6月24日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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24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	7,003,932.63	51,456.56
其中：支付销售机构的客户维护费	121,391.66	27,624.81

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 1.20% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数。}$$

#### 6.4.4.2 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6月24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	1,459,152.68	10,720.12

注：支付基金托管人中国工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6月24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
中国工商银行股份有限公司	1,031,024,200.64	1,733,602.15	12,202,185.59	1,467,170.29

注：本基金的银行存款由基金托管人中国招商银行保管，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

金额单位：人民币元

本期					
2016年1月1日至2016年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	110035	白云转债	网下发行可转债	9,260.00	926,000.00
上年度可比期间					
2015年6月24日（基金合同生效日）至2015年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

#### 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

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股未上市	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股未上市	12.98	12.98	15,341.00	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股未上市	8.49	8.49	1,602.00	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股未上市	10.05	10.05	926.00	9,306.30	9,306.30	-

##### 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601611	中国核建	2016-06-30	重大事项	20.92	2016-07-01	23.01	32,269.00	111,973.43	675,067.48	-
000651	格力电器	2016-02-22	重大事项	22.07	-	-	118,000.00	2,099,488.28	2,604,260.00	

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 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

##### (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 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 3,536,899.54 元，属于第二层次的余额为 106,279,032.70 元，无属于第三层次的余额。(2015 年 12 月 31 日：第一层次 29,707,386.81 元，第二层次 50,142,600.00 元，无第三层次)。

(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。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 25 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 6.4.1)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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(2015 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。

## § 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	6,969,932.24	0.60
	其中：股票	6,969,932.24	0.60
2	固定收益投资	102,846,000.00	8.79
	其中：债券	102,846,000.00	8.79
	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	1,040,125,153.02	88.88
7	其他各项资产	20,254,294.06	1.73
8	合计	1,170,195,379.32	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,906,026.26	0.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,973,287.48	0.17
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	70,492.40	0.01
J	金融业	-	-
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	20,126.10	0.00
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	6,969,932.24	0.60

### 7.3 期末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	000651	格力电器	118,000	2,604,260.00	0.22
2	600519	贵州茅台	6,000	1,751,520.00	0.15
3	002051	中工国际	66,000	1,298,220.00	0.11
4	601611	中国核建	32,269	675,067.48	0.06
5	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.02
6	601966	玲珑轮胎	9,643	125,166.14	0.01
7	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
8	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.01
9	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
10	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00

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度报告正文。

## 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	600900	长江电力	3,920,511.11	0.33
2	000848	承德露露	1,405,097.00	0.12
3	000333	美的集团	1,261,606.00	0.11
4	601966	玲珑轮胎	125,166.14	0.01
5	603377	东方时尚	113,750.40	0.01
6	601900	南方传媒	112,559.06	0.01
7	601611	中国核建	111,973.43	0.01
8	002791	坚朗五金	85,697.61	0.01
9	603919	金徽酒	72,247.76	0.01
10	002788	鹭燕医药	68,314.95	0.01
11	603868	飞科电器	59,372.79	0.00
12	601127	小康股份	50,326.22	0.00
13	002790	瑞尔特	50,104.76	0.00
14	300511	雪榕生物	48,307.04	0.00
15	300512	中亚股份	39,164.43	0.00
16	002789	建艺集团	33,795.00	0.00
17	300474	景嘉微	33,649.88	0.00
18	300516	久之洋	33,142.50	0.00
19	601020	华钰矿业	31,426.86	0.00
20	603101	汇嘉时代	31,390.03	0.00

### 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	600900	长江电力	6,211,977.38	0.52
2	000333	美的集团	3,493,930.00	0.29
3	601939	建设银行	1,907,500.00	0.16
4	000848	承德露露	1,556,787.80	0.13
5	600104	上汽集团	1,509,128.83	0.13

6	300496	中科创达	1,345,227.80	0.11
7	600048	保利地产	1,270,256.00	0.11
8	600887	伊利股份	1,252,350.00	0.11
9	000069	华侨城 A	1,139,200.00	0.10
10	000550	江铃汽车	1,075,137.48	0.09
11	600535	天士力	1,074,546.00	0.09
12	600267	海正药业	1,060,248.60	0.09
13	300202	聚龙股份	1,002,912.10	0.08
14	300495	美尚生态	909,306.50	0.08
15	000001	平安银行	881,479.00	0.07
16	603996	中新科技	787,632.02	0.07
17	000963	华东医药	672,413.00	0.06
18	300494	盛天网络	596,127.39	0.05
19	600585	海螺水泥	576,289.56	0.05
20	300493	润欣科技	484,711.00	0.04

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	8,113,815.88
卖出股票的收入（成交）总额	36,591,592.90

#### 7.5 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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,586,000.00	0.31
8	同业存单	99,260,000.00	8.50
9	其他	-	-
10	合计	102,846,000.00	8.80

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111611177	16 平安 CD177	1,000,000	99,260,000.00	8.50
2	132006	16 皖新 EB	27,000	2,700,000.00	0.23
3	127003	海印转债	8,860	886,000.00	0.08

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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序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仓国债期货

### 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	10,267.07
2	应收证券清算款	19,794,197.94
3	应收股利	-
4	应收利息	425,521.88
5	应收申购款	24,307.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,254,294.06

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000651	格力电器	2,604,260.00	0.22	停牌股票
2	601611	中国核建	675,067.48	0.06	停牌股票
3	601966	玲珑轮胎	125,166.14	0.01	新股未上市

#### 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

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
1,390	810,222.18	1,084,215,905.12	96.27%	41,992,924.41	3.73%

### 8.2 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	IA 持有份额总数 (份)	IA 占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	-	-	-
	合计	-	-

### 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	-	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-	-
	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

基金合同生效日(2015年6月24日)基金份额总额	260,914,518.62
本报告期期初基金份额总额	1,161,434,848.37
本报告期基金总申购份额	1,205,622.27
减：本报告期基金总赎回份额	36,431,641.11
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,126,208,829.53

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票时间 2016 年 2 月 15 日起，至 2016 年 3 月 2 日 17:00 止，会议审议通过了《关于博时新财富混合型证券投资基金降低赎回费率有关事项的议案》。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基

金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

## 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	
西部证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中信建设	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	19,902,814.60	46.09%	18,535.66	48.78%	新增 2 个
银河证券	1	10,429,653.52	24.15%	9,705.14	25.54%	-
方正证券	1	5,713,250.35	13.23%	4,115.65	10.83%	-
首创证券	1	4,498,487.40	10.42%	3,289.76	8.66%	新增 1 个
东吴证券	1	990,849.22	2.29%	822.37	2.16%	新增 1 个
华泰证券	3	562,103.15	1.30%	523.52	1.38%	新增 1 个
广发证券	2	558,703.39	1.29%	520.33	1.37%	-
光大证券	2	522,945.38	1.21%	487.02	1.28%	新增 1 个

### 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	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
西部证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	1,500,000,000.00	12.12%	-	-
中信建设	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	7,984,089.30	68.64%	8,954,000,000.00	72.34%	-	-
方正证券	1,136,339.70	9.77%	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	2,510,592.56	21.59%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	107,200,000.00	0.87%	-	-
光大证券	-	-	1,817,000,000.00	14.68%	-	-

博时基金管理有限公司  
二〇一六年八月二十五日