

博时安丰18个月定期开放债券型证券投资基金 (LOF)

【2015】半年度报告摘要

单位:人民币元

项目	本期 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）	249,663,642.24	21,706,230.78	271,369,873.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,287,541.52	27,287,541.52
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）	192,509,462.18	15,106,076.61	207,614,537.79
其中：1.基金申购款	404,682,148.46	31,693,004.56	436,375,153.02
2.基金赎回款	-212,172,686.28	-16,587,928.95	-228,760,615.23
四、本期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）	-	-30,941,604.47	-30,941,604.47
五、期末所有者权益（基金净值）	442,173,104.42	33,157,243.44	475,330,347.86

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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）	247,589,439.70	2,727,820.35	250,317,260.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,588,200.77	15,588,200.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	757,816.86	8,223.16	766,040.02
其中：1.基金申购款	757,816.86	8,223.16	766,040.02
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期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）	-	-6,690,044.17	-6,690,044.17
五、期末所有者权益（基金净值）	248,357,256.56	11,634,209.11	259,991,465.67

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

除以下会计估计变更外,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: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),按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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收营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的债券利息收入,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、红利时暂按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定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,暂按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂按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方

关联方名称	与本基金的关系	
	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
博时基金管理有限公司(“博时基金”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	基金托管人、基金代销机构	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、基金销售机构	基金管理人、基金销售机构

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

6.4.4.1.1 股票交易

元。

6.4.4.1.2 权证交易

元。

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

元。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期计提	期末余额	当期计提
当期发生的基金应支付的基金管理费	1,303,310.97	754,965.25	1,303,310.97	754,965.25
其中:支付销售机构的客户维护费	209,910.89	289,294.67	209,910.89	289,294.67

注:支付基金管理人博时基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.6%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.6%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期计提	期末余额	当期计提
当期发生的基金应支付的托管费	330,993.31	236,488.52	330,993.31	236,488.52

注:支付基金托管人浦发银行的托管费按前一日基金资产净值0.18%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×0.18%/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

元。

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

元。

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

元。

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

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
浦发银行	5,722,967.35	63,426.24	3,086,946.06	39,025.38

注:本基金的活期银行存款由基金托管人浦发银行保管,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

元。

6.4.5 期末持有的暂时停牌或流通受限股票

元。

6.4.5.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

元。

6.4.5.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额184,799,322.80元,是以如下债券作为质押:

序号	项目	金额		占基金总资产的比例(%)
		期末余额	公允价值	
1	国债投资	-	-	-
2	其中:股票	-	-	-
3	固定收益投资	1,069,982,932.25	96,14	-
4	其中:债券	1,069,982,932.25	96,14	-
5	资产支持证券	-	-	-
6	贵金属投资	-	-	-
7	金融衍生品投资	-	-	-
8	买入返售金融资产	-	-	-
9	其中:买入返售金融资产	-	-	-
10	其中:买入返售金融资产	-	-	-
11	其中:买入返售金融资产	-	-	-
12	其中:买入返售金融资产	-	-	-
13	其中:买入返售金融资产	-	-	-
14	其中:买入返售金融资产	-	-	-
15	其中:买入返售金融资产	-	-	-
16	其中:买入返售金融资产	-	-	-
17	其中:买入返售金融资产	-	-	-
18	其中:买入返售金融资产	-	-	-
19	其中:买入返售金融资产	-	-	-
20	其中:买入返售金融资产	-	-	-
21	其中:买入返售金融资产	-	-	-
22	其中:买入返售金融资产	-	-	-
23	其中:买入返售金融资产	-	-	-
24	其中:买入返售金融资产	-	-	-
25	其中:买入返售金融资产	-	-	-
26	其中:买入返售金融资产	-	-	-
27	其中:买入返售金融资产	-	-	-
28	其中:买入返售金融资产	-	-	-
29	其中:买入返售金融资产	-	-	-
30	其中:买入返售金融资产	-	-	-
31	其中:买入返售金融资产	-	-	-
32	其中:买入返售金融资产	-	-	-
33	其中:买入返售金融资产	-	-	-
34	其中:买入返售金融资产	-	-	-
35	其中:买入返售金融资产	-	-	-
36	其中:买入返售金融资产	-	-	-
37	其中:买入返售金融资产	-	-	-
38	其中:买入返售金融资产	-	-	-
39	其中:买入返售金融资产	-	-	-
40	其中:买入返售金融资产	-	-	-
41	其中:买入返售金融资产	-	-	-
42	其中:买入返售金融资产	-	-	-
43	其中:买入返售金融资产	-	-	-
44	其中:买入返售金融资产	-	-	-
45	其中:买入返售金融资产	-	-	-
46	其中:买入返售金融资产	-	-	-
47	其中:买入返售金融资产	-	-	-
48	其中:买入返售金融资产	-	-	-
49	其中:买入返售金融资产	-	-	-
50	其中:买入返售金融资产	-	-	-
51	其中:买入返售金融资产	-	-	-
52	其中:买入返售金融资产	-	-	-
53	其中:买入返售金融资产	-	-	-
54	其中:买入返售金融资产	-	-	-
55	其中:买入返售金融资产	-	-	-
56	其中:买入返售金融资产	-	-	-
57	其中:买入返售金融资产	-	-	-
58	其中:买入返售金融资产	-	-	-
59	其中:买入返售金融资产	-	-	-
60	其中:买入返售金融资产	-	-	-
61	其中:买入返售金融资产	-	-	-
62	其中:买入返售金融资产	-	-	-
63	其中:买入返售金融资产	-	-	-
64	其中:买入返售金融资产	-	-	-
65	其中:买入返售金融资产	-	-	-
66	其中:买入返售金融资产	-	-	-
67	其中:买入返售金融资产	-	-	-
68	其中:买入返售金融资产	-	-	-
69	其中:买入返售金融资产	-	-	-
70	其中:买入返售金融资产	-	-	-
71	其中:买入返售金融资产	-	-	-
72	其中:买入返售金融资产	-	-	-
73	其中:买入返售金融资产	-	-	-
74	其中:买入返售金融资产	-	-	-
75	其中:买入返售金融资产	-	-	-
76	其中:买入返售金融资产	-	-	-
77	其中:买入返售金融资产	-	-	-
78	其中:买入返售金融资产	-	-	-
79	其中:买入返售金融资产	-	-	-
80	其中:买入返售金融资产	-	-	-
81	其中:买入返售金融资产	-	-	-
82	其中:买入返售金融资产	-	-	-
83	其中:买入返售金融资产	-	-	-
84	其中:买入返售金融资产	-	-	-
85	其中:买入返售金融资产	-	-	-
86	其中:买入返售金融资产	-	-	-
87	其中:买入返售金融资产	-	-	-
88	其中:买入返售金融资产	-	-	-
89	其中:买入返售金融资产	-	-	-
90	其中:买入返售金融资产	-	-	-
91	其中:买入返售金融资产	-	-	-
92	其中:买入返售金融资产	-	-	-
93	其中:买入返售金融资产	-	-	-
94	其中:买入返售金融资产	-	-	-
95	其中:买入返售金融资产	-	-	-
96	其中:买入返售金融资产	-	-	-
97	其中:买入返售金融资产	-	-	-
98	其中:买入返售金融资产	-	-	-
99	其中:买入返售金融资产	-	-	-
100	其中:买入返售金融资产	-	-	-

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期末未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	金额单位:人民币元	
		公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业债券	796,633,632.75	167.60
6	企业短期融资券	27,294,300.00	5.74
7	中期票据	238,065,000.00	49.86
8	可转债	-	-
9	合计	1,060,992,932.75	223.00

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	金额单位:人民币元	
				公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	122028	09浦发债	430,000	45,386,500.00	9.55
2	122778	11浦发债	400,000	44,404,000.00	9.34
3	1089156	10浦发债	400,000	42,476,000.00	8.94
4	122328	12浦发02	400,000	42,416,000.00	8.92
5	1483021	14泰山建投债	400,000	41,620,000.00	8.76

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	金额单位:人民币元	
				公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	122028	09浦发债	430,000	45,386,500.00	9.55
2	122778	11浦发债	400,000	44,404,000.00	9.34
3	1089156	10浦发债	400,000	42,476,000.00	8.94
4	122328	12浦发02	400,000	42,416,000.00	8.92
5	1483021	14泰山建投债	400,000	41,620,000.00	8.76

7.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

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 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	113,402.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,939,390.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,062,817.24