博时弘盈定期开放混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

2019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:二〇一九年八月二十七日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月26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2019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	博时弘盈定开混合	
基金主代码	160520	
交易代码	160520	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年8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	287,633,193.33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	2016年10月26日	
下属分级基金的基金简称	博时弘盈定开混合A	博时弘盈定开混合C
下属分级基金的场内简称	弘盈A	弘盈C
下属分级基金的交易代码	160520	160521
报告期末下属分级基金的份额总额	211,823,042.97份	75,810,150.36份

2.2基金产品说明

投资目标	在谨慎投资的前提下,本基金力争超越业绩比较基准,追求基金资产的保值和增值。
投资策略	封闭期内,主要采用事件驱动的投资策略;开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*25%+中债综合财富(总值)指数收益率*75%。
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于中高预期风险、中高预期收益的基金品种。

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 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(2019年1月1日至2019年6月30日)	
	博时弘盈定开混合A	博时弘盈定开混合C
本期已实现收益	1,466,945.66	205,474.02
本期利润	11,749,872.75	3,819,671.85
加权平均基金份额本期利润	0.0555	0.0504
本期基金份额净值增长率	5.65%	5.23%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
	博时弘盈定开混合A	博时弘盈定开混合C
期末可供分配基金份额利润	0.0361	0.0122
期末基金资产净值	219,474,317.16	76,738,271.54
期末基金份额净值	1.0361	1.0122

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。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

博时弘盈定开混合A

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	1.52%	0.35%	1.75%	0.28%	-0.23%	0.07%
过去三个月	-0.95%	0.46%	0.32%	0.36%	-1.27%	0.10%
过去六个月	5.65%	0.46%	7.92%	0.37%	-2.27%	0.09%
过去一年	5.70%	0.41%	7.39%	0.37%	-1.69%	0.04%
自基金合同生效起至今	3.61%	0.34%	13.11%	0.28%	-9.50%	0.06%

博时弘盈定开混合C

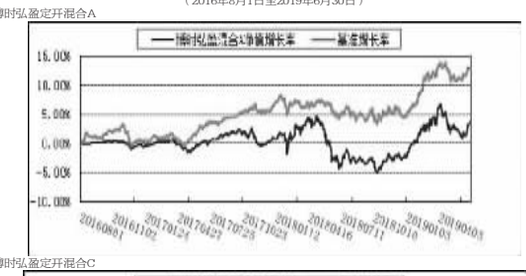
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.45%	0.35%	1.75%	0.28%	-0.30%	0.07%
过去三个月	-1.14%	0.46%	0.32%	0.36%	-1.46%	0.10%
过去六个月	5.23%	0.46%	7.92%	0.37%	-2.69%	0.09%
过去一年	4.86%	0.41%	7.39%	0.37%	-2.53%	0.04%
自基金合同生效起至今	1.22%	0.34%	13.11%	0.28%	-11.89%	0.06%

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率*25%+中债综合财富(总值)指数收益率*75%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照75%、25%的比例采取再平衡,再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

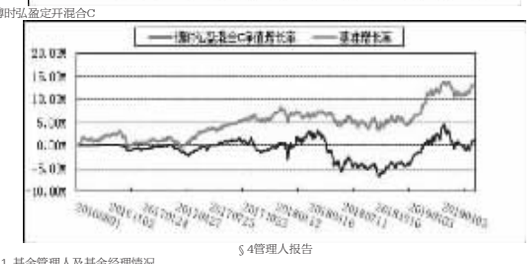
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时弘盈定期开放混合型证券投资基金
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
(2016年8月1日至2019年6月30日)

博时弘盈定开混合A



博时弘盈定开混合C



§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2019年6月30日,博时基金公司共管理185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,管理资产总规模逾9345亿元人民币,剔除货币基金与短期理财债券基金后,博时基金公募资产管理总规模逾2699亿元人民币,累计分红逾980亿元人民币,是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计,截至2019年2季末:

博时旗下权益类基金业绩亮眼,54只产品(各类份额分开计算,不含QDII,下同)今年来净值增长率银河同类排名在前1/2,31只银河同类排名在前1/4,15只银河同类排名在前1/10,15只银河同类排名在前10。其中,博时回报灵活配置混合、博时乐臻定期开放混合、博时医疗保健行业混合今年来净值增长率分别在145只、61只、14只同类产品中排名第1;博时量化平衡混合、博时弘泰定期开放混合、博时上证50ETF联接(A类)、博时上证50ETF联接(C类)、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(C类)今年来净值增长率分别在102只、61只、46只、34只、15只同类产品中排名第3;博时特许价值混合(A类)今年来净值增长率在414只同类产品中排名第20;博时鑫源灵活配置混合(C类)、博时鑫源灵活配置混合(A类)、博时上证50ETF、博时新起点灵活配置混合(A类)、博时颐泰混合(C类)、博时睿利事件驱动灵活配置混合(LOF)等基金今年来净值增长率排名在银河同类前1/10;博时颐泰混合(A类)、博时新兴消费主题混合、博时鑫瑞灵活配置混合(C类)、博时新起点灵活配置混合(C类)、博时鑫泽灵活配置混合(C类)、博时文体娱乐主题混合、博时新兴成长混合、博时鑫瑞灵活配置混合(A类)、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(A类)、博时创新驱动灵活配置混合(C类)、博时鑫泽灵活配置混合(A类)、博时裕益灵活配置混合、博时沪港深优质企业灵活配置混合(A类)、博时沪港深优质企业灵活配置混合(C类)等基金今年来净值增长率排名在银河同类前1/4。

博时固定收益类基金业绩表现稳健,58只产品(各类份额分开计算,不含QDII,下同)今年来净值增长率银河同类排名前1/2,29只银河同类排名在前1/4,16只银河同类排名在前1/10,10只银河同类排名在前10。债券型基金中,博时转债增强债券(A类)、博时转债增强债券(C类)今年来净值增长率分别在28只、15只同类产品中排名第1,且分别在全市场参与业绩排名的1928只债券基金中排名第3、第4;博时安盈债券(A类)、博时安盈债券(C类)今年来净值增长率分别在同类产品中排第2、第3;博时安弘一年定期开放债券(A类)、博时安康18个月定期开放债券(LOF)、博时安心收益定期开放债券(A类)、博时岁岁增利一年定期开放债券、博时月月薪定期支付债券今年来净值增长率分别在239只同类产品中排名第3、第7、第14、第18、第23;博时裕泰纯债债券、博时裕顺纯债债券、博时富瑞纯债债券、博时富祥纯债债券、博时裕腾纯债债券今年来净值增长率分别在352只同类产品中排名第6、第11、第12、第26、第28;博时安弘一年定期开放债券(C类)今年来净值增长率在58只同类产品中排名第3;博时信用债券(A/B类)、博时信用债券(C类)今年来净值增长率在228只、163只同类产品中均排名第11;博时富兴纯债3个月定期开放债券发起式、博时裕瑞纯债债券、博时裕创纯债债券、博时双月薪定期支付债券、博时安心收益定期开放债券(C类)、博时裕盛纯债债券、博时裕恒纯债债券、博时裕盈纯债3个月定期开放债券发起式、博时裕安纯债债券、博时安丰18个月定期开放债券(A类-LOF)等基金今年来净值增长率排名在银河同类前1/4。货币型基金中,博时合惠货币(B类)今年来净值增长率在296只同类产品中排名第8,博时合惠货币(A类)、博时现金宝货币(B类)、博时现金宝货币(A类)等基金今年来净值增长率排名在银河同类前1/4。

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		
陈鹏扬	权益投资GARP组投资副总监/基金经理	2016-08-01	-	11.0	陈鹏扬先生,硕士。2008年至2012年在中金公司工作。2012年加入博时基金管理有限公司。历任研究员、资深研究员、投资经理、博时睿远定增灵活配置混合型证券投资基金(2016年4月15日-2017年10月16日)、博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金(2016年8月19日-2018年2月22日)、博时弘裕18个月定期开放债券型证券投资基金(2016年8月30日-2018年5月5日)、博时睿利事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2017年12月4日-2018年8月13日)、博时睿丰灵活配置定期开放混合型证券投资基金(2017年3月22日-2018年12月8日)、博时弘康18个月定期开放债券型证券投资基金(2017年3月24日-2019年3月21日)的基金经理。现任权益投资GARP组投资副总监兼博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金(2015年8月24日-至今)、博时弘盈定期开放混合型证券投资基金(2016年8月1日-至今)、博时弘泰定期开放混合型证券投资基金(2016年12月9日-至今)、博时睿远事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2017年10月17日-至今)、博时睿益事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2018年2月23日-至今)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 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《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

基于大类资产比较考虑,年初组合增加了在转债资产的配置仓位,取得一定效果。权益投资上组合仓位继续往优质公司集中,在食品饮料、计算机等板块的配置取得一定效果。但由于定增项目到期陆续退出,相应二级市场持仓呈现下降,整体权益仓位不高,在市场上涨中跑输基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年06月30日,本基金A类基金份额净值为1.0361元,份额累计净值为1.0361元,本基金C类基金份额净值为1.0122元,份额累计净值为1.0122元。报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为5.65%,本基金C类基金份额净值增长率为5.23%,同期业绩基准增长率7.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为3季度经济下行压力将有所加大,尽管贸易战有所缓和,但关税提高的负面效应在3季度会开始体现。投资机会主要集中于产业升级和消费升级,一方面,国内从政府到企业加速自主创新的趋势不变,工程师红利的比较优势驱动的国内产业升级、科技升级。另一方面收入分配向劳动者倾斜下消费提升可期,消费升级趋势未改,老龄化、新兴消费持续存在结构性机会。另外,地产后周期的低估值板块中,部分标的有业绩和估值修复机会。

从中周期的角度而言,我们认为国内经济增长的动能正在发生以下不可逆的变化,相应的产业趋势以及投资机会不容忽视,工程师红利驱动的成长类板块迎来较好的布局时点。

要素端,从劳动力红利到工程师红利。从人口结构来看,我国适龄工作人群数量开始下降,单纯的劳动力红利已经不具备优势,工资成本进入持续上行通道。但另一方面,我国大学生年毕业人数超过700万人,其中40%以上集中于科学、工程等;毕业生人数超过美国+欧洲综合,且发达国家工科、科学相关比例只有20%。中国工程师的工作强度位居全球前列,而工资待遇仅为发达国家的1/7-1/10,在医药、通信、电子、汽车等中高端制造业产业链中,中国开始具备人力资源的比较优势。

从粗放式增长到有质量的增长,信息化、智能化推动生产效率的持续提升。从产值角度,我国制造业在全球领先优势明显,但从质量和效率而言,确还有较大提升空间。在人工成本上升以及劳动力短缺背景下,制造业的信息化、智能化改造是大势所趋,我们在一些领先的行业龙头中已经看到效果,国内某工程机械龙头在过去7年时间内,通过内部信息化、智能化改造,人均单产提升3倍,人均产出从远远落后日本、美国同行,到大幅超越日本,基本接近美国对标公司,且随着新技术应用陆续落地,效率提升还会继续。

5G、AI等新技术运用带来的产业升级。在5G和AI等新一代的技术基础上,我国和发达国家之间的差距明显缩小,部分领域如视频分析上甚至具备全球竞争优势,这一类新技术的应用将进一步促进国内产业的持续升级。

鼓励创新、加强知识产权保护,科创板推出带来科技类公司的成长环境的改善。从上述几个维度而言,我们预计未来在国内,企业级服务、创新药、智能制造、高端装备等产业会迎来较好的发展机遇,其中更具竞争力的龙头企业在中周期维度将迎来更好的表现。

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债金融估值中心有限公司签署服务协议,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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度,我行在履行托管职责中,严格遵守有关法律法规、托管协议的规定,尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款,对托管产品的投资行为进行监督,并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则,独立地设置、登录和保管本产品的全套账册,进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确,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:博时弘盈定期开放混合型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:	-	-
银行存款	5,484,671.19	3,938,653.24
结算备付金	4,936,350.02	4,418,306.09
存出保证金	46,649.50	22,665.92
交易性金融资产	481,693,161.96	505,300,867.67
其中:股票投资	71,074.90	41,451,983.39
基金投资	-	-
债券投资	481,622,087.06	463,848,884.28
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	7,915,460.11	8,023,815.19
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	500,076,292.78	521,704,308.11
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负债:	-	-
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	201,000,000.00	239,999,856.00
应付证券清算款	2,058,542.67	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	288,042.15	285,306.36
应付托管费	48,007.01	47,551.08
应付销售服务费	49,760.19	49,433.04
应付交易费用	31,130.16	13,329.55
应交税费	32,620.62	41,419.81
应付利息	35,595.64	274,368.17
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	320,005.64	350,000.00
负债合计	203,863,704.08	241,061,264.01
所有者权益:	-	-
实收基金	287,633,193.33	287,633,193.33
未分配利润	8,579,395.37	-6,990,149.23
所有者权益合计	296,212,588.70	280,643,044.10
负债和所有者权益总计	500,076,292.78	521,704,308.11

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额总额 287,633,193.33份。其中A类基金份额净值1.0361元,基金份额总额 211,823,042.97份;C类基金份额净值1.0122元,基金份额总额 75,810,150.36份。

6.2 利润表

会计主体:博时弘盈定期开放混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	21,727,525.35	30,053,701.84
1.利息收入	8,030,088.29	11,511,225.00
其中:存款利息收入	68,177.44	646,948.63
债券利息收入	7,950,737.28	7,573,607.78
资产支持证券利息收入	-	446,995.76
买入返售金融资产收入	11,173.57	2,843,672.83
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-199,687.86	9,111,146.14
其中:股票投资收益	-1,515,211.00	31,499,949.82
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,318,806.34	-24,121,858.62
资产支持证券投资收益	-	628,602.74
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-3,283.20	1,104,452.20
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	13,897,124.92	9,430,747.22
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	583.48
减:二、费用	6,157,980.75	9,423,877.06
1. 管理人报酬	1,743,843.96	5,287,960.21
2. 托管费	290,640.69	881,326.70
3. 销售服务费	301,622.29	1,223,077.84
4. 交易费用	156,989.71	1,318,640.65
5. 利息支出	3,495,747.47	438,587.98
其中:卖出回购金融资产支出	3,495,747.47	438,587.98
6. 税金及附加	24,618.91	21,049.83
7. 其他费用	144,517.72	253,233.85
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	15,569,544.60	20,629,824.78
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	15,569,544.60	20,629,824.78

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时弘盈定期开放混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	287,633,193.33	-6,990,149.23	280,643,044.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,569,544.60	15,569,544.60
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	287,633,193.33	8,579,395.37	296,212,588.70
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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)	3,329,657,442.45	702,655.93	3,330,360,098.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,629,824.78	20,629,824.78
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)	-3,042,024,249.12	-28,151,018.06	-3,070,175,267.18
其中:1.基金申购款	43,447.70	-487.26	42,960.44
2.基金赎回款	-3,042,067,696.82	-28,150,530.80	-3,070,218,227.62
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)	287,633,193.33	-6,818,537.35	280,814,655.98

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[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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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,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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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、基金销售机构
中国招商银行股份有限公司("招商银行")	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、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

6.4.4.1.1股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	62,097,563.14	64.97%	453,883,839.92	59.79%

6.4.4.1.2权证交易

无。

6.4.4.1.3债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	107,026,394.88	38.69%	39,458,286.66	5.11%

6.4.4.1.4债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	5,653,900,000.00	100.00%	14,837,700,000.00	99.80%

6.4.4.1.5应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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	45,402.68	64.96%	28,070.62	91.63%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	331,928.27	59.41%	18,153.81	14.48%

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,743,843.96	5,287,960.21
其中:支付销售机构的客户维护费	759,249.13	2,165,431.30

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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.20% / 当年天数。

6.4.4.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	290,640.69	881,326.70

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0.20%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:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

6.4.4.2.3销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时弘盈定开混合A	博时弘盈定开混合C	合计
博时基金	-	1,081.16	1,081.16
招商银行	-	300,421.68	300,421.68
合计	-	301,502.84	301,502.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时弘盈定开混合A	博时弘盈定开混合C	合计
博时基金	-	2,247.90	2,247.90
招商银行	-	1,220,829.94	1,220,829.94
合计	-	1,223,077.84	1,223,077.84

注:本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费按C类基金份额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,按月支付给博时基金 ,再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日销售服务费=前一日基金资产净值×0.80%/ 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	5,484,671.19	25,027.09	11,523,835.05	535,900.70

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行间业利率计息。

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

无。

6.4.5 期末(2019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