博时中证银行指数分级证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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:二〇一八年八月二十九日

§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2018年8月28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2018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	174,166,606.25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	博时银行分级基金	博时银行分级基金A	博时银行分级基金B
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	142,964,736.25份	15,600,935.00份	15,600,935.00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组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。		
下属分级基金的风险收益特征	预期风险较高、预期收益较高	低风险、预期收益相对稳定	高风险、高预期收益

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(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期已实现收益	943,405.15
本期利润	-26,899,565.38
加权平均基金份额本期利润	-0.1584
本期基金份额净值增长率	-11.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0475
期末基金资产净值	154,372,753.40
期末基金份额净值	0.8864

3.2 基金净值表现

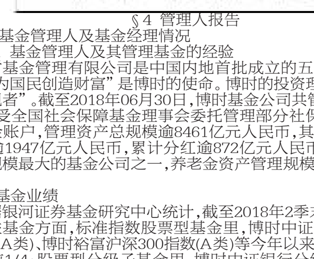
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-6.60%	0.87%	-7.05%	0.84%	0.45%	0.03%
过去三个月	-10.06%	0.96%	-11.16%	0.95%	1.10%	0.01%
过去六个月	-11.85%	1.15%	-12.96%	1.16%	1.11%	-0.01%
过去一年	-3.10%	1.02%	-7.26%	1.02%	4.16%	0.00%
过去三年	-4.02%	1.30%	-12.37%	1.29%	8.35%	0.01%
自基金合同生效起至今	-5.09%	1.33%	-21.15%	1.35%	16.06%	-0.02%

注:本基金的业绩比较基准为: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%。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95%、5%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2018年6月30日)



§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2018年06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8461亿元人民币,其中非货币公募基金规模逾1947亿元人民币,累计分红逾872亿元人民币,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,截至2018年2季末:

权益基金方面,标准指数股票型基金里,博时中证银联智惠大数据100指数(A类)、博时裕富沪深300指数(A类)等今年以来净值增长率同类排名为前1/4;股票型分级子基金里,博时中证银行分级指数(B级)等今年以来净值增长同类基金中排名为前1/3;混合偏股型基金中, 博时创业成长混合(C类)今年以来净值增长率同类基金排名第一,博时创业成长混合(A类) 今年以来净值增长率同类基金排名位居前1/10,博时行业轮动混合等今年以来净值增长率同类排名为前1/3; 混合灵活配置型基金中,博时裕益灵活配置混合基金今年以来净值增长率为3.14%,在166只同类基金排名第6, 博时汇智回报灵活配置混合基金今年以来净值增长率为4.38% ,同类基金排名位居前1/10,博时新价值灵活配置混合(A类)、博时新策略灵活配置混合(A类)、博时新起点灵活配置混合(A类)、博时新起点灵活配置混合(C类)今年以来净值增长率分别为2.12%、1.93%、1.65%、1.60%,同类基金排名均位居前1/8,博时新价值灵活配置混合(C类)今年以来净值增长率为2.07%,同类基金中排名位于前1/6。

黄金基金类,博时黄金ETF联接(A类)、博时黄金ETF联接(C类)今年以来净值增长率同类排名第一。

固收方面,长期标准债券型基金中,博时天颐债券(A类)、博时宏观回报债券(A/B类)、博时信用债券(A/B类)今年以来净值增长率为5.11%、4.56%、4.54%,同类219只基金中分别排名第3、第8、第9位,博时天颐债券(C类)、博时信用债券(R类)、博时信用债券(C类)、博时宏观回报债券(C类)今年以来净值增长率分别为4.88%、4.56%、4.34%、4.23%,同类153只基金中分别排名第2、第4、第7、第8位,博时富华纯债债券、博时景兴纯债债券、博时富益纯债债券、博时裕康纯债债券、博时富发纯债债券、博时聚瑞纯债债券等今年以来净值增长率分别为4.43%、4.10%、3.98%、3.93%、3.89%、3.88%,同类排名前1/10;货币基金类,博时兴荣货币、博时合惠货币(A类)今年以来净值增长率分别为2.21%、2.18%,在315只同类基金排名中位列第15位与第24位。

QDII基金方面,博时标普500ETF(QDII)、博时标普500ETF联接(QDII)(A类),今年以来净值增长率同类排名分别位于前1/5、1/4。

2、其他大事件

2018年6月8日,由《中国证券报》主办的中国基金业二十周年高峰论坛暨第十五届"中国基金业金牛奖"颁奖典礼在苏州隆重举行。经过激烈且公平的票选,博时基金获得"2017年度最受信赖金牛基金公司"荣誉称号。

2018年5月24日,由《中国基金报》、《证券时报》主办的"第五届中国基金业英华奖、中国基金业20年最佳基金经理评选颁奖典礼暨高峰论坛"在深圳隆重举行。从业经历逾23年的博时基金副总经理兼高级投资经理董良泓荣获"中国基金业20年最佳基金经理"殊荣,此荣誉于全行业仅有20人获评;博时基金固收名将陈凯杨则凭借长期稳健的投资业绩荣膺"三年期纯债投资最佳基金经理"称号。值得一提的是,这也是陈凯杨继2016年之后连续两年蝉联该项殊荣,足见市场对其管理业绩的认可。

2018年5月23日,由新浪财经和济安金信主办的"致敬公募20年"颁奖典礼在北京举行,公募基金老五家之一的博时基金凭借长期优良的投研业绩、雄厚的综合资管实力和对价值投资理念的一贯倡导共揽获"最佳资产管理公司"、"最受投资者欢迎基金公司"、"行业特别贡献奖"和"区域影响力奖–珠三角"这四项最具份量的公司大奖;博时基金总经理江向阳获得"行业领军人物奖"。同时,博时旗下产品博时双月薪定期支付债券基金(000277)获得"最具价值理念基金产品奖–债券型",博时亚洲票息收益债券(QDII)(人民币050030:,美元现汇:050202,美元现钞:050203)获得"最具投资价值基金产品奖–QDII"。

2018年5月17日,被誉为"证券期货行业科学技术领域最高荣誉"的第六届证券期货科学技术奖的评审结果近日在北京揭晓。博时基金从上百个竞争对手中脱颖而出, 一举夺得二等奖(DevOps统一研发平台)、三等奖(证券投资基金行业核心业务软件系统统一测试)以及优秀奖(新一代基金理财综合业务接入平台)三项大奖,成为获得奖项最多的金融机构之一。

2018年5月10日,由《上海证券报》主办的"2018中国基金业峰会暨第十五届金基金奖颁奖典礼"在上海举行。在此次颁奖典礼上,博时基金揽获"金基金TOP基金公司"这一最具份量的公司大奖;博时基金权益投资总部董事总经理兼股票投资部总经理李权胜获评 "金基金最佳投资回报基金经理奖"。在第15届金基金奖评选中,旗下价值投资典范产品博时主题行业(160505)获得"三年期金基金分红奖"。

2018年3月26日, 第十五届中国基金业金牛奖评奖结果也拉开帷幕。公募"老五家"之一的博时基金凭借长期出色的投资业绩、锐意进取的创新姿态和对价值投资的坚守一举夺得全场份量最重的 "中国基金业20年卓越贡献公司" 大奖。同时, 旗下绩优产品博时主题行业混合(LOF)(160505)荣获"2017年度开放式混合型金牛基金"奖;博时信用债纯债债券(050027)荣获"三年期开放式债券型持续优胜金牛基金"奖。

2018年3月22日,由中国基金报、香山财富论坛主办的"第五届中国机构投资者峰会暨中国基金业英华奖公募基金20周年特别评选、中国基金业明星基金奖颁奖典礼"在北京举办,本次评选中,博时基金一举斩获本届"20周年特别评选"中最具分量的两项公司级大奖——公募基金20年"十大最佳基金管理人"奖和"最佳固定收益基金管理人"奖,同时,旗下明星基金博时主题行业、博时信用债券分别将"最佳回报混合型基金"奖和"最佳回报债券型基金(二级债)"奖双双收入囊中,博时聚润纯债债券则获得"2017年度普通债券型明星基金"奖。

2018年2月2日,由金融界举办"第二届智能金融国际论坛" 暨第六届金融界"领航中国"年度盛典在南京举办,此次论坛以"安全与创新"为主题,邀请业内专家学者就现阶段行业发展的热点问题深入探讨。博时基金凭借优异的投资业绩与卓越的品牌影响力斩获 "五年期投资回报基金管理公司奖"和"杰出品牌影响力奖"两项大奖。

2018年1月11日,由中国基金报主办的"中国基金产品创新高峰论坛暨中国基金业20年最佳创新产品奖颁奖典礼"在上海举办。博时基金一举摘得"十大产品创新基金公司奖",旗下产品博时主题行业混合基金(160505)和博时黄金ETF分别获得"最佳主动权益创新产品奖"和"最佳互联网创新产品奖",成为当天最大赢家之一。

2018年1月9日, 由信息时报主办的 "第六届信息时报金狮奖——2017年度金融行业风云榜颁奖典礼"在广州隆重举行。博时基金凭借优秀的基金业绩和广泛的社会影响力荣获"年度最具影响力基金公司"大奖。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
赵云阳	基金经理	2015-10-08	-	7.8	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(2013.9.13-2015.2.9)、博时招财一号保本基金(2015.4.29-2016.5.30)、博时中证淘金大数据100基金(2015.5.4-2016.5.30)、博时沪深300指数基金(2015.5.5-2016.5.30)、上证企债30ETF基金(2013.7.11-2018.1.26)基金经理。现任博时深证基本面200ETF基金(2012.11.13-至今)、博时深证基本面200ETF联接基金(2012.11.13-至今)、博时证券保险指数分级基金(2015.5.19-至今)、博时黄金ETF基金(2015.10.8-至今)、博时上证50ETF基金(2015.10.8-至今)、博时上证50ETF联接基金(2015.10.8-至今)、博时银行分级基金(2015.10.8-至今)、博时黄金ETF联接基金(2016.5.27-至今)的基金经理。
尹浩	高级研究员兼基金经理助理	2015-10-08	-	6	2012年起先后在华宝证券、国金证券工作。2015年6月加入博时基金管理有限公司。现任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

2018年上半年,国内宏观经济仍在筑底阶段, 6 月官方制造业PMI和新订单小幅下行,预计6 月经济景气最多有小幅下行,考虑到去年6月环比增速巨大,6 月工业增加值同比增速大概率会掉到6.0%以下。购进价格指数显示PPI 同比增速将有所回升。5 月工业企业的利润较4 月有小幅上升,收入有小幅下降。国内因金融去杠杆、中美贸易战等因素,导致蓝筹股指跌幅较大,而对质押融资风险的担忧,导致中小创指也出现较为明显的下行。上证50和沪深300分别下跌13.30%、12.94%,中证500下跌16.53%,中证1000下跌20.08%,而创业板指表现相对较好,仅下跌8.33%。板块方面,受避险情绪影响,仅餐饮旅游、医药、食品饮料板块上涨,而通信、电力设备、有色金属等板块表现较差。从行情来看,前半年涨跌幅为正的行业仅有食品饮料、餐饮旅游、食品饮料三个行业,涨幅分别是10.15%、4.46%、1.82%;跌幅较大的行业有综合、电力设备、通信、有色金属、机械,跌幅分别是32.12%、27.00%、26.66%、23.21%、22.15%。

本基金为被动跟踪指数的基金,以期获得和跟踪标的指数所表征的市场平均水平的收益。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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年06月30日,本基金基金份额净值为0.8864元,份额累计净值为0.9491元。报告期内,本基金基金份额净值增长率为-11.85%,同期业绩基准增长率-12.96%。

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2018年下半年,宏观经济方面,宏观政策边际上有改善,监管政策也有调整,显示政府对股市下跌有政策应对,过度悲观的情绪将得到修复,看好市场反弹,反弹中相对看好成长板块。利率方面,中美贸易争端、国内金融收缩和货币政策应对性调整,均强化了市场的避险情绪,持续推升利率债的结构性行情,利率水平有望延续下行趋势。综合考虑,中美贸易战、棚改货币化预期及人民币贬值等各类风险因素,我们认为大部分已反映到行情中,看好下半年的市场行情,投资者可关注成长板块的投资机会。结构上,总体仍均衡配置,风格可稍偏成长。但中美贸易争端前景依然迷茫, 而A 股的股权质押风险、信用风险也未得到充分清理。国内股市已处于底部,但即使有所反弹,仍建议保持仓位。

在投资策略上, 博中证银行分级基金作为一只被动的指数基金,我们会以最小化跟踪误差为目标,紧密跟踪中证银行指数。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,发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人,基金管理人在合理期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

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:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:	-	-
银行存款	9,211,610.99	8,138,706.57
结算备付金	68,923.41	17,906.25
存出保证金	25,342.02	14,407.10
交易性金融资产	146,397,878.37	132,206,528.25
其中:股票投资	146,397,878.37	132,206,528.25
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	1,399,994.91	286,420.49
应收利息	1,879.70	1,751.67
应收股利	-	-
应收申购款	211,529.59	195,086.85
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	157,317,158.99	140,860,807.18
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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	-	-
应付证券清算款	-	4.00
应付赎回款	2,421,236.23	632,781.23
应付管理人报酬	138,438.40	119,469.81
应付托管费	30,456.43	26,283.34
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	98,006.74	37,725.46
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	256,267.79	292,008.37
负债合计	2,944,405.59	1,108,272.21
所有者权益:	-	-
实收基金	162,654,267.98	129,790,005.25
未分配利润	-8,281,514.58	9,962,529.72
所有者权益合计	154,372,753.40	139,752,534.97
负债和所有者权益总计	157,317,158.99	140,860,807.18

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.8864元,基金份额总额174,166,606.25 份(其中母基金基金份额净值0.8864元,基金份额总额142,964,736.25 份;A类基金份额净值1.0289元,基金份额总额 15,600,935.00 份;B类基金份额净值0.7439元,基金份额总额 15,600,935.00 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:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	-25,414,460.94	14,065,323.92
1.利息收入	52,984.95	33,851.67
其中:存款利息收入	39,829.72	27,583.98
债券利息收入	9,896.33	5,418.37
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,258.90	849.32
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	2,204,466.25	3,254,366.60
其中:股票投资收益	832,033.80	1,732,046.84
基金投资收益	-	-
债券投资收益	320.00	27,474.68
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	1,372,112.45	1,494,845.08
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-27,842,970.53	10,722,659.65
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	171,058.39	54,446.00
减:二、费用	1,485,104.44	1,235,325.60
1. 管理人报酬	847,846.86	680,095.20
2. 托管费	186,526.27	149,620.95
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	149,143.20	104,182.89
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	301,588.11	301,426.56
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-26,899,565.38	12,829,998.32
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-26,899,565.38	12,829,998.32

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:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	129,790,005.25	9,962,529.72	139,752,534.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-26,899,565.38	-26,899,565.38
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)	32,864,262.73	8,655,521.08	41,519,783.81
其中:1.基金申购款	161,751,571.41	21,634,016.79	183,385,588.20
2.基金赎回款	-128,887,308.68	-12,978,495.71	-141,865,804.39
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)	162,654,267.98	-8,281,514.58	154,372,753.40
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	144,439,067.64	-15,875,061.78	128,564,005.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,829,998.32	12,829,998.32
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)	-2,246,552.08	128,980.57	-2,117,571.51
其中:1.基金申购款	52,107,080.25	-3,531,563.52	48,575,516.73
2.基金赎回款	-54,353,632.33	3,660,544.09	-50,693,088.24
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)	142,192,515.56	-2,916,082.89	139,276,432.67

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 主管会计工作的负责人: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》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、深府办[2011]60号《深圳市地方教育附加征收管理暂行办法》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。

(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)本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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

6.4.4.1.1股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	-	-	2,980,756.00	4.18%

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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	2,179.73	3.64%	2,179.73	5.53%

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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	847,846.86	680,095.20
其中:支付销售机构的客户维护费	254,788.10	165,157.26

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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	186,526.27	149,620.95

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 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
中国建设银行	9,211,610.99	38,370.05	7,365,642.70	26,885.13

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2018年6月30日, 本基金持有622,800股托管人公司中国建设银行的A股普通股(2017年6月30日:485,800股),成本总额为人民币4,227,994.40元(2017年6月30日:2,607,303.59元),估值总额为人民币4,079,340.00元(2017年6月30日:2,987,670.00元),占基金资产净值的比例为2.64%(2017年6月30日:2.16%)。

6.4.5 期末(2018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

6.4.8.1.1受限证券类别:股票

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
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股未上市	13.09	13.09	1,765.00	23,103.85	23,103.85

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

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2018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146,374,774.52元,属于第二层次的余额为23,103.85元, 无属于第三层次的余额 (2017年12月31日:第一层次132,169,631.80元,第二层次36,896.45元,无属于第三层次的余额)。

(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2018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(2017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	146,397,878.37	93.06
	其中:股票	146,397,878.37	93.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,280,534.40	5.90
8	其他各项资产	1,638,746.22	1.04
9	合计	157,317,158.99	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	23,103.85	0.01
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	146,293,548.38	94.77
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	81,226.14	0.05
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	146,397,878.37	94.83

7.2.2 积极投资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所有股票投资明细

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	600036	招商银行	817,159	21,605,683.96	14.00
2	601166	兴业银行	1,011,500	14,565,600.00	9.44
3	600016	民生银行	1,918,500	13,429,500.00	8.70
4	601328	交通银行	2,229,600	12,797,904.00	8.29
5	601288	农业银行	3,102,100	10,671,224.00	6.91
6	601398	工商银行	1,750,300	9,311,596.00	6.03
7	600000	浦发银行	952,748	9,108,270.88	5.90
8	601169	北京银行	1,201,054	7,242,355.62	4.69
9	000001	平安银行	696,660	6,332,639.40	4.10
10	601988	中国银行	1,710,400	6,174,544.00	4.00
11	601229	上海银行	316,740	4,991,822.40	3.23
12	601818	光大银行	1,292,280	4,729,744.80	3.06
13	601939	建设银行	622,800	4,079,340.00	2.64
14	600015	华夏银行	520,264	3,875,966.80	2.51
15	601009	南京银行	481,816	3,724,437.68	2.41
16	600919	江苏银行	562,100	3,603,061.00	2.33
17	002142	宁波银行	205,696	3,350,787.84	2.17
18	601998	中信银行	248,700	1,544,427.00	1.00
19	601997	贵阳银行	111,900	1,383,084.00	0.90
20	600926	杭州银行	119,000	1,319,710.00	0.85
21	601128	常熟银行	90,200	515,944.00	0.33
22	002839	张家港行	73,300	446,397.00	0.29
23	600908	无锡银行	75,000	441,750.00	0.29
24	002807	江阴银行	71,700	402,954.00	0.26
25	603323	吴江银行	58,700	362,179.00	0.23
26	601838	成都银行	32,300	282,625.00	0.18
27	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.05
28	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01

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所有股票投资明细

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	600036	招商银行	10,761,339.18	7.70
2	601166	兴业银行	7,379,594.00	5.28
3	600016	民生银行	6,716,815.80	4.81
4	601328	交通银行	6,069,219.86	4.34
5	601288	农业银行	5,422,482.00	3.88
6	600000	浦发银行	5,040,252.88	3.61
7	601398	工商银行	4,977,294.00	3.56
8	601229	上海银行	4,446,003.00	3.18
9	000001	平安银行	3,638,340.00	2.60
10	601169	北京银行	3,589,169.66	2.57
11	601988	中国银行	3,099,632.00	2.22
12	601818	光大银行	2,352,226.00	1.68
13	601939	建设银行	2,318,991.00	1.66
14	601009	南京银行	2,007,412.91	1.44
15	600015	华夏银行	1,998,776.92	1.43
16	600919	江苏银行	1,754,532.13	1.26
17	002142	宁波银行	1,672,936.55	1.20
18	600926	杭州银行	1,180,096.00	0.84
19	601998	中信银行	729,934.00	0.52
20	601997	贵阳银行	708,356.56	0.51

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	600036	招商银行	5,814,157.35	4.16
2	601166	兴业银行	3,675,331.28	2.63
3	600016	民生银行	3,293,333.75	2.36
4	601328	交通银行	3,101,333.00	2.22
5	600000	浦发银行	2,573,249.05	1.84
6	601288	农业银行	2,527,813.00	1.81
7	601398	工商银行	2,301,573.00	1.65
8	000001	平安银行	1,746,683.00	1.25
9	601169	北京银行	1,687,076.96	1.21
10	601988	中国银行	1,517,697.00	1.09
11	601818	光大银行	1,137,564.00	0.81
12	600015	华夏银行	976,842.12	0.70
13	002142	宁波银行	850,847.00	0.61
14	600919	江苏银行	770,892.00	0.55
15	601939	建设银行	731,326.00	0.52
16	601009	南京银行	634,570.00	0.45
17	603259	药明康德	583,190.41	0.42
18	601998	中信银行	364,416.00	0.26
19	601997	贵阳银行	341,086.00	0.24
20	601229	上海银行	293,541.00	0.21

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	79,006,789.65
卖出股票的收入(成交)总额	37,804,502.80

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体除浦发银行(600000)、兴业银行(601166)外没有出现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、处罚的情形。

2018年1月20日,上海浦东发展银行股份有限公司发布公告称,因成都分行内控管理严重失效,授信管理违规,违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为,银监会四川监管局对上海浦东发展银行成都分行处以罚款的行政处罚。

2018年4月19日,因重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告等原因,中国银行保险监督管理委员会对兴业银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

对该股票投资决策程序的说明:

根据我司的基金投资管理相关制度, 以相应的研究报告为基础,结合其未来增长前景,由基金经理决定具体投资行为。

7.10.2 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。

7.10.3 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	25,342.02
2	应收证券清算款	1,399,994.91
3	应收股利	-
4	应收利息	1,879.70
5	应收申购款	211,529.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,638,746.22

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

7.10.5.1 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。

7.10.5.2 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。

7.10.6 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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
博时银行分级基金	13,206	10,825.74	226,922.00	0.16%	142,737,814.25	99.84%
博时银行分级基金A	125	124,807.48	2,483,222.00	15.92%	13,117,713.00	84.08%
博时银行分级基金B	228	68,425.15	770,000.00	4.94%	14,830,935.00	95.06%
合计	13,559	12,845.09	3,480,144.00	2.00%	170,686,462.25	98.00%

8.2 期末上市基金前十名持有人

博时银行分级基金A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	梁小红	3,755,403.00	24.07%
2	孙林红	1,337,755.00	8.57%
3	余晓敏	1,080,079.00	6.92%
4	傅喜元	862,000.00	5.53%
5	上海迎水投资管理有限公司-迎水龙凤呈祥2号私募证券投资基金	770,000.00	4.94%
6	中量投资产管理有限公司-中量投量化多策略1号私募基金	700,000.00	4.49%
7	史向东	573,000.00	3.67%
8	张鹏	563,200.00	3.61%
9	恒安标准人寿保险有限公司-传统分红险	411,819.00	2.64%
10	曾翔	400,000.00	2.56%

博时银行分级基金B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	穆松	2,363,976.00	15.15%
2	伍兰佳	1,765,901.00	11.32%
3	赵冬	1,166,700.00	7.48%
4	芮根火	1,103,783.00	7.08%
5	范正荣	1,000,035.00	6.41%
6	李永泉	920,326.00	5.90%
7	上海迎水投资管理有限公司-迎水龙凤呈祥2号私募证券投资基金	770,000.00	4.94%
8	芮健平	737,134.00	4.72%
9	魏舒力	593,515.00	3.80%
10	吴敏	450,556.00	2.89%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时银行分级基金	274,445.42	0.19%
	博时银行分级基金A	-	-
	博时银行分级基金B	-	-
	合计	274,445.42	0.16%

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的情况

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	博时银行分级基金	0
	博时银行分级基金A	-
	博时银行分级基金B	-
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	博时银行分级基金	0~10
	博时银行分级基金A	-
	博时银行分级基金B	-
	合计	0~10

注: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。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	博时银行分级基金	博时银行分级基金A	博时银行分级基金B
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	105,150,383.74	16,913,045.00	16,913,045.00
本报告期基金总申购份额	173,199,540.29	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	138,009,407.78	-	-
本报告期基金拆分变动份额	2,624,220.00	-1,312,110.00	-1,312,110.00
本报告期期末基金份额总额	142,964,736.25	15,600,935.00	15,600,935.00

注:报告期间基金拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换以及基金折算导致的份额变动。

§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、基金托管人的专门基金托管部门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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
民生证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	79,122,932.17	68.32%	73,671.46	72.92%	-
平安证券	1	27,946,392.53	24.13%	20,437.82	20.23%	新增1个
天风证券	1	6,111,133.28	5.28%	4,469.88	4.42%	-
中金公司	1	2,636,497.27	2.28%	2,456.56	2.43%	-

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	回购交易 成交金额	占当期回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
民生证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	3,199,680.00	100.00%	10,000,000.00	100.00%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

博时基金管理有限公司

二〇一八年八月二十九日