

博时亚洲票息收益债券型证券投资基金

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,由新浪财经和证安信主办的“致敬公募20年”颁奖典礼在北京举行,公募基金有五大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价值投资理念的一贯倡导者荣获“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基金定期支付债券基金(000277)获得“最具价值理念基金产品奖-债券券型”,博时亚洲票息收益债券(ODII)(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-ODII”。

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颁奖典礼近日在北京揭晓。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中国基金业颁奖典礼”在上海举行。在此次颁奖典礼上,博时基金荣获“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”。在第十五届中国基金业颁奖典礼上,博时基金荣获“2017年度最佳基金经理”和“杰出固收收益基金经理人”奖,同时,旗下明星基金博时主题行业、博时信用债券分别将“最佳回报混合型固收”奖和“最佳回报债券型基金(二星级)”奖双双收入囊中,博时聚源纯债债券则获得“2017年度普通债券型明星基金”奖。

2018年2月2日,由基金界举办“第二届资管金融国际论坛”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成绩与卓越的品牌影响力斩获“五年期投资回报最佳资产管理公司奖”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“中国基金业创新高峰论坛暨中国基金业20年最佳创新产品颁奖典礼”在上海举行。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,由信惠时主办的“第六届信惠时基金颁奖奖”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。

报告截止日:2018年6月30日

资产	单位:人民币元	
	本报告期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
流动资产	208,196,251.23	163,564,569.63
其中:货币资金	7,046,922.22	6,929,508.92
交易性金融资产	1,462,165,955.94	1,962,897,174.56
其中:股票投资	22,522,906.49	-
债券投资	1,462,165,955.94	1,962,897,174.56
其他金融资产	-	-
非流动资产	2,231,165.61	30,721,097.17
其中:可供出售金融资产	-	-
其他非流动资产	2,231,165.61	30,721,097.17
资产总计	210,427,416.84	194,285,666.80
负债和所有者权益	210,427,416.84	194,285,666.80
负债	-	-
所有者权益	210,427,416.84	194,285,666.80
其中:实收资本	610	610
其他综合收益	-	-
未分配利润	210,427,416.84	194,285,666.80
所有者权益合计	210,427,416.84	194,285,666.80

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.2406元,基金份额总额1,529,244,984.66份

6.2 利润分配

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:2018年1月1日至2018年6月30日

项目	单位:人民币元	
	本报告期 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	9,748,873.30	15,269,585.46
1.利息收入	63,509,271.89	61,795,569.94
其中:国债利息收入	46,666,242.32	67,659,659.94
债券利息收入	52,894,206.26	61,729,062.57
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”号填列)	-77,019,342.89	59,236,387.73
其中:权益法投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
其他投资收益	-77,019,342.89	59,236,387.73
资产支持证券投资收益	-	-
公允价值变动收益	8,530,972.81	2,277,877.94
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-31,499,433.37	-99,544,063.36
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	2,409,949.63	-2,470,127.23
5.其他收入(损失以“-”号填列)	2,184,699.03	2,186,762.55
减:一、费用	11,282,214.62	11,124,140.30
1. 管理费用	8,300,976.14	8,273,004.63
2. 托管费	2,631,665.69	2,638,314.63
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	189,647.21	5,145.45
5. 其他费用	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
二、公允价值变动损益(损失以“-”号填列)	221,396.27	369,450.65
7. 其他损益	200,677.81	300,650.65
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-61,032,088.64	4,136,420.67
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-61,032,088.64	4,136,420.67

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:2018年1月1日至2018年6月30日

项目	单位:人民币元		
	本报告期 2018年1月1日至2018年6月30日	本报告期初	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,467,625,874.63	468,812,852.87	2,136,438,529.69
二、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)	-	-41,032,088.64	-41,032,088.64
1. 本期基金净申购产生的基金份额增加额(净申购减少以“-”号填列)	-138,500,004.16	-29,778,383.37	-168,268,272.53
2. 本期基金净赎回产生的基金份额减少额(净赎回增加以“-”号填列)	396,425,944.93	49,308,214.43	268,269,154.36
3. 本期基金份额持有人申购、赎回基金份额产生的损益	-344,004,825.08	-79,621,023.30	-423,625,827.98
三、本期所有者权益(基金净值)合计	1,429,244,984.66	397,396,119.56	1,897,240,164.62

本报告期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《关于企业所得税优惠政策的通知》、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《关于金融同业机构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有关问题的通知》、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《关于个人住房贷款进项税额抵扣有关问题的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]589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《国务院令(征收教育费附加的暂行规定)》、沪府发[2012]92号《上海市人民政府关于本市开征地方教育附加的通知》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,不再缴纳;已缴纳增值税的,已缴纳增值税额中抵减。

(2) 目前基金取得源自境外的差价收入和利息收入,其涉及的境外所得税政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税政策,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和企业所得税。

(4) 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相关方

关联方名称	与本基金的关联关系
博时基金管理有限公司(“博时基金”)	基金管理人、母公司、金融机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、金融机构
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金销售人、金融机构

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交易的情况
6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.4.2 关联方报酬

2018年半年度报告摘要

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上期可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金总费用的管理费率	8,500,976.14	8,273,004.63
其中:支付机构投资者的资产管理费	3,269,537.37	675,884.67

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 2018年1月1日至2018年6月30日	上期可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金总费用的托管费	2,521,596.69	2,085,314.63

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:日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 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
6.4.4.4 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
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	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
招商银行	67,470,706.27	46,086,322
招商证券	60,425,524.06	-
其他	-	110,062,171.68
合计	127,896,230.33	156,148,493.88

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鲁克哈里曼曼保管,按适用利率约定利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期间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(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
6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
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
6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购
6.4.5.3.3 其他

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
(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

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
(b) 持续的以公允价值计量的金融工具