博时中证银行指数分级证券投资基金
2018 年年度报告
2018 年 12 月 31 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

报告送出日期：二〇一九年三月二十九日

§1 重要提示及目录

1.1 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 2019 年 3 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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 1
1.1 重要提示 1
1.2 目录 2
§2 基金简介 4
2.1 基金基本情况 4
2.2 基金产品说明 4
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 5
2.5 其他相关资料 5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 5
3.1 主要会计数据和财务指标 5
3.2 基金净值表现 6
3.3 过去三年基金的利润分配情况 7
§4 管理人报告 7
4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
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 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
4.9 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 16
§5 托管人报告 16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 17
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 17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 17
§6 审计报告 17
6.1 审计意见 17
6.2 形成审计意见的基础 18
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任 18
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任 18
§7 年度财务报表 19
7.1 资产负债表 19
7.2 利润表 20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 21
7.4 报表附注 23
§8 投资组合报告 45
8.1 期末基金资产组合情况 45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 46
8.3 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 46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 49

8.6 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.....49
8.7 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.....49
8.8 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.....49
8.9 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.....49
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....49
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....49
8.12 投资组合报告附注.....49
§9 基金份额持有人信息.....50
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....51
9.2 期末上市基金前十名持有人.....51
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....52
9.4 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.....52
§10 开放式基金份额变动.....52
§11 重大事件揭示.....53
11.1 基金份额持有人大会决议.....53
11.2 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.....53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....53
11.4 基金投资策略的改变.....53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....53
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....53
11.8 其他重大事件.....55
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....57
12.1 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.....57
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....57
§13 备查文件目录.....57
13.1 备查文件目录.....57
13.2 存放地点.....57
13.3 查阅方式.....57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时中证银行指数分级证券投资基金		
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	182,504,435.05 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	152,021,129.05 份	15,241,653.00 份	15,241,653.00 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构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、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
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		518040	100033
法定代表人		张光华	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	2,089,747.19	8,014,357.81	-1,317,767.20
本期利润	-25,994,901.23	26,638,447.97	-4,068,656.86
加权平均基金份额本期利润	-0.1490	0.1746	-0.0255
本期加权平均净值利润率	-15.46%	18.44%	-3.04%
本期基金份额净值增长率	-10.98%	20.97%	-1.82%
3.1.2 期末数据和指标	**2018 年末**	**2017 年末**	**2016 年末**
期末可供分配利润	-6,881,742.19	-1,331,242.44	-15,875,061.78

期末可供分配基金份额利润	-0.0377	-0.0096	-0.1052
期末基金资产净值	159,099,925.92	139,752,534.97	128,564,005.86
期末基金份额净值	0.8718	1.0056	0.8518
3.1.3 累计期末指标	**2018 年末**	**2017 年末**	**2016 年末**
基金份额累计净值增长率	-4.14%	7.68%	-10.99%

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

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
过去三个月	-9.07%	1.29%	-8.85%	1.30%	-0.22%	-0.01%
过去六个月	1.00%	1.30%	-1.08%	1.30%	2.08%	0.00%
过去一年	-10.98%	1.22%	-13.90%	1.23%	2.92%	-0.01%
过去三年	5.73%	1.01%	-6.06%	1.01%	11.79%	0.00%
自基金合同生效起至今	-4.14%	1.33%	-22.00%	1.34%	17.86%	-0.01%

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

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2015 年 6 月 9 日至 2018 年 12 月 31 日）

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时中证银行指数分级证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注：本基金的基金合同于 2015 年 6 月 9 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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 12 月 31 日，博时基金公司共管理 181 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 8638 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 2439 亿元人民币，累计分红逾 916 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 4 季末：

博时固定收益类基金业绩表现亮眼。在参与银河排名的 107 只固收产品（各类份额分开计算）中，有 54 只产品银河同类排名前 1/2。债券型基金中，博时宏观回报债券 A/B 类、博时宏观回报债券 C 类 2018 年全年净值增长率均分别在 200 只、142 只同类基金中排名第 1，博时天颐债券 A 类 2018 年全年净值增长率在 200 只同类基金中排名第 4，博时天颐债券 C 类 2018 年全年净值增长率在 142 只同类基金中排名第 5，博时富华纯债债券、博时富瑞纯债债券、博时裕康纯债债券、博时双月薪定期支付债券 2018 年全年净值增长率排名均在银河同类前 1/10，博时富发纯债债券、博时裕利纯债债券、博时富益纯债债券 2018 年全年净值增长率排名均在银河同类前 1/8；货币型基金中，博时合惠货币 B 类、博时现金宝货币 B 类 2018 年全年净值增长率分别在 291 只同类基金中排名第 8、第 29，博时合惠货币 A 类 2018 年全年净值增长率在 311 只同类基金中排名第 11。

博时旗下权益类基金业绩表现稳健。2018 年 A 股市场震荡下行，博时旗下参与银河排名的 83 只权益产品（各类份额分开计算）中，56 只银河同类排名在前 1/2。其中，股票型基金里，博时工业 4.0 主题、博时丝路主题业绩排名均在银河同类前 1/4；混合型基金中，博时乐臻定开混合 2018 年全年净值增长率在 44 只同类基金中均排名第 4，博时新兴消费主题、博时汇智回报、博时新策略 A 类、博时新收益等基金业绩排名在银河同类前 1/10，博时逆向投资、博时战略新兴产业、博时裕隆、博时鑫泰 A 类等基金业绩排名在银河同类前 1/4；指数基金中，博时上证超大盘 ETF 及其联接基金等基金业绩排名在银河同类前 1/10，博时上证 50ETF 及其联接基金 A 类业绩排名在银河同类前 1/6，博时沪深 300 指数业绩排名在银河同类前 1/3。

商品型基金当中，博时黄金 ETF 联接 A 类 2018 年全年净值增长率同类排名第 1。

QDII 基金方面，博时标普 500ETF、博时标普 500ETF 联接 A 类 2018 年全年净值增长率银河同类排名均位于前 1/3。

2、 其他大事件

2018 年 12 月 28 日，由新华网主办的第十一届“中国企业社会责任峰会”暨 2018 中国社会责任公益盛典在京隆重举行。凭借多年来对责任投资的始终倡导和企业公民义务的切实履行，老牌公募巨头博时基金在本次公益盛典上荣获“2018 中国社会责任杰出企业奖”。

2018 年 12 月 22 日，东方财富在南京举办的“2018 东方财富风云榜暨基情 20 年”颁奖典礼上，

博时基金喜获两项大奖，博时基金江向阳总经理获得“基情 20 周年最受尊敬行业领袖”奖；博时主题行业混合（LOF）荣登“天天基金年度产品热销榜”。

2018 年 12 月 21 日，由华夏时报社主办的“华夏机构投资者年会暨第十二届金蝉奖颁奖盛典”在北京召开，本次年会的主题是“金融业 2019 年：突破与回归”，博时基金荣获“2018 年度基金管理公司”。

2018 年 12 月 21 日，由北京商报社、北京品牌协会主办的“科技赋能与金融生态再造”——2018 年度（第四届）北京金融论坛在京成功举办，博时基金荣获“技术领先价值奖”。

2018 年 12 月 15 日，第二届腾讯理财通金企鹅奖暨财富高峰论坛在深圳举行。会上揭晓了第二届金企鹅奖获奖名单，其中博时安盈债券基金（A 类：000084、C 类：000085）凭借年内出色的业绩表现以及在 90 后用户中的超高人气，一举斩获“最受 90 后用户喜爱的产品奖”。

2018 年 11 月 16 日，由《每日经济新闻》主办的“2018 公募基金高峰论坛暨金鼎奖颁奖典礼”在成都举行，凭借突出的资管实力和对价值投资的坚守，博时基金一举摘得“公募 20 年特别贡献奖——创造收益”这一重磅奖项，同时，旗下专户板块获“专户业务最具竞争力基金公司”奖。

2018 年 11 月 1 日，博时基金正式加入联合国责任投资原则组织（简称 UN PRI），成为中国较早加入 UN PRI 国际组织的资产管理机构之一。

2018 年 10 月 17 日，由南方财经全媒体集团和 21 世纪传媒举办的 21 世纪国际财经峰会暨“金帆奖”评选在深圳举行，凭借对价值投资理念的坚守和出色的综合资管能力，博时基金一举斩获“2018 年度基金管理公司金帆奖”这一重磅奖项。

2018 年 9 月 7 日，由证券时报主办的“2018 中国 AI 金融探路者峰会暨第二届中国金融科技先锋”榜颁奖典礼在深圳举行，凭借长期的敬业精神和沉淀的创新思维，博时基金副总裁王德英获得了“2018 中国金融科技领军人物先锋”的荣誉。

2018 年 9 月 6-9 日，在阿拉善生态基金会主办，深圳证券信息、全景网协办，深交所、证券业协会、基金业协会、期货业协会、上市公司协会等单位支持的 " 2018 第三届绿色行走公益长征暨沙漠穿越挑战·赛 " 中，由 4 名博时员工朱盟（信息技术部）、过钧（固定收益总部）、王飞（信息技术部）、王盼（信息技术部）组成的代表队，成功穿越内蒙古阿拉善盟腾格里沙漠，率先全员抵达终点获得团体冠军，其中王飞更获得个人第一。

2018 年 8 月，全国社会保障基金境内委托投资管理人 2017 年度考评结果出炉，博时基金投研能力获得高度认可，在公司基本面单项考评中获 A 档，三个社保委托组合获评“综合考评 A 档”，此为社保考评结果的最高档。同时，在社保投资经理的考评中，博时基金共收获 3 项个人奖项。博时基金副总裁兼高级投资经理董良泓独揽社保理事会特别颁发的“10 年长期贡献社保表彰”，用于

肯定其过去十年在同一家公司管理社保组合，含金量极高。同时，董良泓本人还摘得“10 年贡献社保表彰”的殊荣，该奖项授予长期为社保服务且业绩优秀的投资管理人，本次仅授予 2 人。此外，博时基金董事总经理兼年金投资部总经理欧阳凡获评“3 年贡献社保表彰”。

2018 年 7 月 19 日，由中国证券投资基金业协会主办的“中国基金业 20 周年——发展中的思考与启示”主题论坛在深圳隆重举行。博时基金凭借雄厚的资管实力、出色的投研业绩、锐意创新的拼搏精神获得基金业协会的高度认可，一举摘得“优秀基金管理人”大奖；副总经理王德英此次荣获“杰出专业人士”的殊荣。同时，博时主题行业混合（LOF）（160505）更是以长期优异的业绩上榜“优秀基金产品”。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵云阳	指数与量化投资部投资副总	2015-10-08	-	8.4	赵云阳先生，硕士。2003 年至 2010 年在晨星中国研究

	监/基金经理				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、量化分析师兼基金经理助理、博时特许价值混合型证券投资基金(2013 年 9 月 13 日-2015 年 2 月 9 日)、博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金(2015 年 4 月 29 日-2016 年 5 月 30 日)、博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2015 年 5 月 4 日-2016 年 5 月 30 日)、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2015 年 5 月 5 日-2016 年 5 月 30 日)、上证企债 30 交易型开放式指数证券投资基金(2013 年 7 月 11 日-2018 年 1 月 26 日)、博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2012 年 11 月 13 日-2018 年 12 月 10 日)、深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金(2012 年 11 月 13 日-2018 年 12 月 10 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时中证 800 证券保险指数分级证券投资基金(2015 年 5 月 19 日—至今)、博时中证银行指数分级证券投资基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时黄金交易型开放式证券投资基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (2015 年 10 月 8 日—至今)、博时黄金交易型开放式证券投资基金联接基金(2016 年 5 月 27 日—至今)、博时中证央企结构调整

					交易型开放式指数证券投资基金(2018 年 10 月 19 日—至今)、博时中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2018 年 11 月 14 日—至今)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2018 年 12 月 10 日—至今)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金(2018 年 12 月 10 日—至今)的基金经理。
尹浩	高级研究员兼基金经理助理	2015-10-08	-	6.5	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 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了《公平交易管理制度》，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.3.2 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。

4.3.3 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 年形势较为严峻，国内经济数据继续下滑叠加中美贸易战，经济下行压力明显。12 月份中国制造业 PMI 指数回落至 49.4，已跌至荣枯线一下，意味着制造业景气出现了明显的下滑，经济下行承压。国际油价在前三季度震荡上行，但从 10 月开始，原油大幅受供给提升以及库存飙升等因素影响出现持续大幅下跌。国际市场方面，2018 年上半年美国经济强劲，股市延续上涨趋势,但总体呈震荡上行，但四季度在美联储持续加息，国债收益率持续上行，叠加长短期利率倒挂引发投资者对美国经济衰退的担忧，美股及其他发达国家股市大跌。汇率方面，上半年人民币兑美元大幅贬值，资金流出压力较大，下半年人民币汇率开始稳住，资金流出压力减小。

2018 年 A 股在 1 月底冲高后开始回落，去杠杆叠加贸易战使投资者情绪低落，呈现出缩量下跌的趋势，全年处于熊市之中。尽管大中小盘普跌，但上证 50 相对较为抗跌，宽基指数中，上证 50 下跌 19.83%，沪深 300 指数下跌 25.31%，中证 500、中证 1000、创业板指则分别下跌 33.32%、36.87%、28.65%。行业方面，中信一级行业中，较为抗跌的前五大行业为餐饮旅游、银行、石油石化、食品饮料和农林牧渔，跌幅分别为 3.73%、5.28%、5.51%、6.54%，而综合、电子元器件、有色金属、传媒及机械领跌，跌幅分别是 42.45%、41.31%、40.93%、38.59%和 34.84%。

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 12 月 31 日,本基金基金份额净值为 0.8718 元，份额累计净值为 0.9586 元。报告期内,本基金基金份额净值增长率为-10.98%,同期业绩基准增长率-13.90%。

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 2019 年，中国经济增长或将持续承压。一方面，从中观高频行业数据看，2018 年 12 月的制造业 PMI 及 PMI 所有分项指标都在变差。可以看出，接下来经济增长压力继续加大，国内需求和生产均有走弱。另一方面，央行在 2019 年开年即宣布了降准，体现了中央经济工作会议加大逆周期政策力度的执行，也反应了稳增长的决心。但当前的政策导向和实际的执行尚未有推高社会融资规

模增速的明确迹象，这也意味着企业盈利情况总体难见改观。此外，中美本周在北京会进行具体的磋商，预计中美贸易谈判有可能在往好的方向发展，如果贸易谈判进展良好，有可能决定全年的投资者情绪，进而提升市场风险偏好。海外方面，鲍威尔发言偏向“鸽派”，如对货币政策调整将有“耐心”；如果造成问题，将毫不犹豫调整缩表政策，有助于全球风险偏好提升。

A 股经历了 2018 年估值大幅下挫，2019 年市场估值水平下行空间有限，企业的业绩边际变化是需重点关注。我们认为，2019 年主导 A 股走势将是盈利下行、逆周期政策以及市场风险偏好的合力。全年看，经济、盈利持续走弱的状况短时间内不会有明显改善，逆周期政策及外部环境的积极变化，有可能带来风险偏好的提高。总体来看，2019 年 A 股震荡回升的概率较大，不同板块之间的企业业绩可能会出现明显的分化，A 股市场会存在一些结构性机会。结构上关注 1）逆周期政策方向，如 5G、基建；2）具有较高安全垫的高股息、低估值股票；3）业绩较为稳定，周期性较弱的板块，如医药、食品饮料等行业。

在投资策略上，博时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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

2018 年，我公司根据法律、法规的规定，制定了《合规管理制度》、《养老目标证券投资基金子基金选择标准与制度》等制度。修订了《合规考核管理制度》、《投资决策委员会制度》、《债券型基金投资股票管理流程》等制度文件，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断建设及完善“新一代投资决策支持系统”、“博时客户关系管理系统”、“博时投资决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：在存续期内，本基金（包括博时银行份额、博时银行 A 份额、博时银行 B 份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会备案后，如果终止博时银行 A 份额与博时银行 B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。

4.9 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 审计报告

普华永道中天审字(2019)第 23449 号

博时中证银行指数分级证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了博时中证银行指数分级证券投资基金(以下简称“博时银行分级基金”)的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了博时银行分级基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博时银行分级基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

博时银行分级基金的基金管理人博时基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估博时银行分级基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算博时银行分级基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督博时银行分级基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对博时银行分级基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博时银行分级基金不能持续经营。

（五）评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天
会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师
_____
张　　振　　波

中国•上海市

注册会计师
_____
沈　　兆　　杰

2019 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	8,857,868.17	8,138,706.57
结算备付金		10,743.94	17,906.25
存出保证金		13,776.04	14,407.10
交易性金融资产	7.4.7.2	151,109,158.32	132,206,528.25
其中：股票投资		151,109,158.32	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		40,214.48	286,420.49
应收利息	7.4.7.5	2,154.44	1,751.67
应收股利		-	-
应收申购款		70,137.63	195,086.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		**160,104,053.02**	**140,860,807.18**
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2018 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	4.00
应付赎回款		338,935.62	632,781.23
应付管理人报酬		140,884.26	119,469.81
应付托管费		30,994.57	26,283.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	102,051.26	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	7.4.7.8	391,261.39	292,008.37
负债合计		**1,004,127.10**	**1,108,272.21**
所有者权益：		**-**	**-**
实收基金	7.4.7.9	165,981,668.11	129,790,005.25
未分配利润	7.4.7.10	-6,881,742.19	9,962,529.72
所有者权益合计		**159,099,925.92**	**139,752,534.97**
负债和所有者权益总计		**160,104,053.02**	**140,860,807.18**

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 182,504,435.05 份，其中博时中证银行指数分级证券投资基金之基础份额的份额总额为 152,021,129.05 份，基金份额净值 0.8718 元；博时中证银行指数分级证券投资基金之 A 份额的份额总额为 15,241,653.00 份，基金份额参考净值 1.0038 元；博时中证银行指数分级证券投资基金之 B 份额的份额总额为 15,241,653.00 份，基金份额参考净值 0.7398 元。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		**-23,119,278.76**	**29,235,189.42**
1.利息收入		91,368.66	73,189.63
其中：存款利息收入	7.4.7.11	78,213.43	62,844.42
债券利息收入		9,896.33	7,644.57
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,258.90	2,700.64
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,614,098.05	10,320,822.02
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-568,112.04	5,998,634.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	320.00	19,382.87
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	5,181,890.09	4,302,804.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-28,084,648.42	18,624,090.16
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	259,902.95	217,087.61
减：二、费用		**2,875,622.47**	**2,596,741.45**
1．管理人报酬		1,685,711.19	1,442,407.84
2．托管费		370,856.50	317,329.74
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	7.4.7.18	214,260.33	231,227.87
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	7.4.7.19	604,794.45	605,776.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-25,994,901.23**	**26,638,447.97**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**-25,994,901.23**	**26,638,447.97**

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	-	-25,994,901.23	-25,994,901.23
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）	36,191,662.86	9,150,629.32	45,342,292.18
其中：1.基金申购款	229,730,434.97	22,399,520.92	252,129,955.89
2.基金赎回款	-193,538,772.11	-13,248,891.60	-206,787,663.71
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）	165,981,668.11	-6,881,742.19	159,099,925.92
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	-	26,638,447.97	26,638,447.97
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）	-14,649,062.39	-800,856.47	-15,449,918.86
其中：1.基金申购款	197,266,011.69	5,088,670.57	202,354,682.26
2.基金赎回款	-211,915,074.08	-5,889,527.04	-217,804,601.12
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）	129,790,005.25	9,962,529.72	139,752,534.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告从 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时中证银行指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]757 号《关于准予博时中证银行指数分级证券投资基金注册的批复》和中国证监会证券基金机构监管部机构部函[2015]1370 号《关于博时中证银行指数分级证券投资基金募集时间安排的确认函》核准，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 287,111,881.09 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 679 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 287,168,470.70 份基金份额(场内基金份额为 140,576,476.00 份，场外基金份额为 146,591,994.70 份)，其中认购资金利息折合 56,589.61 份基金份额(折合场内基金份额为 6,476.00 份，场外基金份额为 50,113.61 份)。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同》和《博时中证银行指数分级证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金的基金份额包括博时中证银行指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“博时银行份额”)、博时中证银行指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“博时银行 A 份额”)及博时中证银行指数分级证券投资基金之进取收益类份额(以下简称“博时银行 B 份额”)。其中，博时银行 A 份额、博时银行 B 份额的基金份额配比始终保持 1∶1 的比例不变。本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后，场外认购的全部基金份额将确认为博时银行份额；场内认购的全部基金份额按照 1:1 的比例自动分离为预期收益与预期风险不同的两种份额类别，即博时银行 A 份额和博时银行 B 份额。基金合同生效后，博时银行份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。博时银行 A 份额和博时银行 B 份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不接受单独的申购与赎回。投资者可在场内申购和赎回博时银行份额，投资者可选择将其在场内申购的博时银行份额按 1:1 的比例分拆成博时银行 A 份额和博时银行 B 份额。投资者也可按 1:1 的配比将其持有的博时银行 A 份额和博时银行 B 份额申请合并为场内的博时银行份额。投资者可在场外申购和赎回博时银行份额。投资者不得申请将其场外申购的博时银行份额进行分拆，但投资者可将其持有的场外博时银行份额跨系统转托管至

场内并申请将其分拆成博时银行 A 份额和博时银行 B 份额后上市交易。在博时银行 A 份额、博时银行 B 份额的存续期内，基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。

本基金按《博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同》约定的净值计算规则对博时银行 A 份额和博时银行 B 份额分别进行基金份额参考净值计算，一份博时银行 A 份额的参考净值与一份博时银行 B 份额的参考净值之和等于两份博时银行份额的净值。博时银行 A 份额每日获得日基准收益，博时银行 A 份额实际的投资盈亏都由博时银行 B 份额分享与承担。博时银行 A 份额的日基准收益均以 1.0000 元面值为基准采取单利进行计算。博时银行 A 份额的约定年基准收益率为：一年期银行定期存款年利率(税后)+ 3.5%。其中计算博时银行 A 份额约定年基准收益率的一年期银行定期存款利率以最近一次基金份额的定期折算基准日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率(税后)为准，基金合同生效日至基金合同生效后第一个基金份额的定期折算基准日(含)之间的年约定基准收益率为基金合同生效日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率(税后)+3.5%。

本基金将根据《博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同》的约定进行定期/不定期份额折算。

本基金在存续期内每个会计年度 12 月份的第一个工作日，将进行基金的定期份额折算，博时银行 A 份额和博时银行 B 份额按照《博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同》中规定的参考净值计算规则进行净值计算，对博时银行 A 份额的约定应得收益进行定期份额折算，每 2 份博时银行份额将按 1 份博时银行 A 份额获得约定应得收益的新增博时银行份额的份额，按上述份额折算后，博时银行 A 份额的基金份额参考净值和博时银行份额的基金份额净值作相应的调整，博时银行 B 份额不进行折算。在基金份额折算前与折算后，博时银行 A 份额和博时银行 B 份额的份额配比保持 1：1 的比例不变。根据净资产不变的原则，将博时银行 A 份额每个会计年度定期折算基准日折算前的份额参考净值超过 1.0000 元的部分转换成博时银行场内份额；博时银行份额持有人所持有的每两份博时银行份额按照一份博时银行 A 份额获得新增博时银行份额的分配，按上述份额折算后，博时银行 A 份额的基金份额参考净值和博时银行份额的基金份额净值作相应的调整，博时银行 B 份额不进行折算。

本基金还将在以下两种情况根据基金合同进行不定期份额折算，(1) 当博时银行份额的基金份额净值大于或等于 1.500 元时，折算前的博时银行份额持有人，获得新增博时银行份额的份额分配。博时银行份额持有人持有的博时银行份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元，份额数量相应折算增加；折算前的博时银行 A 份额持有人，以博时银行 A 份额在基金份额折算基准日折算前的基金份额参考净值超出 1.000 元部分，获得新增场内博时银行份额的份额分配。博时银行 A 份额持有人持

有的博时银行 A 份额净值折算调整为 1.000 元、份额数量不变，相应折算增加场内博时银行份额；折算前的博时银行 B 份额持有人，以博时银行 B 份额在基金份额折算基准日折算前的基金份额参考净值超出 1.000 元部分，获得新增场内博时银行份额的份额分配。博时银行 B 份额持有人持有的博时银行 B 份额净值折算调整为 1.000 元、份额数量不变，相应折算增加场内博时银行份额。(2) 当博时银行 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时，博时银行份额持有人持有的博时银行份额的基金份额净值折算调整为 1.000 元、份额数量相应折算调整；博时银行 A 份额持有人持有的博时银行 A 份额的基金份额参考净值折算调整为 1.000 元、份额数量相应折算调整，相应折算增加博时银行份额；折算不改变博时银行 B 份额持有人的资产净值，其持有的博时银行 B 份额的基金份额参考净值折算调整为 1.000 元、份额数量相应折算调整；博时银行 A 份额与博时银行 B 份额的基金份额配比保持 1：1 的比例不变。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2015]第 275 号文审核同意，博时银行 A 份额(150267) 70,288,238.00 份基金份额和博时银行 B 份额(150268) 70,288,238.00 份基金份额于 2015 年 6 月 18 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 90%～95%，其中，中证银行指数成分股和备选成分股占基金非现金资产的比例不低于 80%；债券、货币市场工具、现金、权证、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具及其他资产占基金资产的 5%～10%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%～3%。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%。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2019 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国

基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制.

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为股指期货投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为股指期货投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金

额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2）交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在存续期内，本基金(包括博时银行份额、博时银行 A 份额、博时银行 B 份额)不进行收益分配。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)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、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	8,857,868.17	8,138,706.57
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	8,857,868.17	8,138,706.57

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		175,941,848.44	151,109,158.32	-24,832,690.12
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		175,941,848.44	151,109,158.32	-24,832,690.12
项目		上年度末 2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		128,954,569.95	132,206,528.25	3,251,958.30
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		128,954,569.95	132,206,528.25	3,251,958.30

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,142.23	1,735.72
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	5.39	8.91
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	6.82	7.04
合计	2,154.44	1,751.67

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	102,051.26	37,725.46
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	102,051.26	37,725.46

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付赎回费	1,261.39	2,008.37
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
预提费用	340,000.00	240,000.00
合计	391,261.39	292,008.37

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	138,976,473.74	129,790,005.25
本期申购	246,190,124.92	229,730,434.97
本期赎回（以“-”号填列）	-207,545,553.81	-193,538,772.11
基金拆分/份额折算变动份额	4,883,390.20	-
本期末	182,504,435.05	165,981,668.11

注：1. 本基金的基金份额包括博时银行份额、博时银行 A 份额和博时银行 B 份额。本期申购含申购的博时银行份额和配对转入的博时银行 A 份额和博时银行 B 份额，本期赎回含赎回的博时银行份额和配对转出的博时银行 A 份额和博时银行 B 份额。

2. 截至 2018 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的博时银行 A 份额为 15,241,653.00 份(2017 年 12 月 31 日：16,913,045.00 份)，博时银行 B 份额为 15,241,653.00 份(2017 年 12 月 31 日：16,913,045.00 份)，托管在场内未上市交易的博时银行份额为 2,705,694.00 份(2017 年 12 月 31 日：7,447,053.00 份)，托管在场外未上市交易的博时银行份额为 149,315,435.05 份(2017 年 12 月 31 日：97,703,330.74)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回。未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。博时银行份额与博时银行 A 份额、博时银行 B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。

3.根据《博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定《关于博时中证银行指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》，本基金的基金管理人确定 2018 年 12 月 3 日为份额折算基准日，对博时银行份额的场外份额、场内份额以及博时银行 A 份额实施定期份额折算。折算前，博时银行份额场外和场内份额分别为 148,758,005.12 份和 2,460,620.00 份，根据基金份额折算公式，份额折算比例为 0.026870678，折算后博时银行份额场外份额总额和场内份额总额分别为 152,754,686.32 份和 3,347,329.00 份，博时银行份额份额净值为 0.9355 元；折算前，博时银行 A 份额份额总额为 15,269,271.00 份，根据基金份额折算公式，份额折算比例为 0.053741356，折算后博时银行 A 份额份额总额为 15,269,271.00 份，份额净值为 1.0000 元。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,331,242.44	11,293,772.16	9,962,529.72
本期利润	2,089,747.19	-28,084,648.42	-25,994,901.23
本期基金份额交易产生的变动数	-10,895.94	9,161,525.26	9,150,629.32
其中：基金申购款	269,325.33	22,130,195.59	22,399,520.92
基金赎回款	-280,221.27	-12,968,670.33	-13,248,891.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	747,608.81	-7,629,351.00	-6,881,742.19

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	75,209.03	61,436.68
定期存款利息收入	-	-

其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,764.69	979.88
其他	1,239.71	427.86
合计	78,213.43	62,844.42

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	60,405,000.42	85,316,620.87
减：卖出股票成本总额	60,973,112.46	79,317,986.39
买卖股票差价收入	-568,112.04	5,998,634.48

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,306,240.00	2,282,398.67
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,199,680.00	2,241,300.00
减：应收利息总额	106,240.00	21,715.80
买卖债券差价收入	320.00	19,382.87

7.4.7.14 衍生工具收益

无发生额。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,181,890.09	4,302,804.67
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,181,890.09	4,302,804.67

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
1.交易性金融资产	-28,084,648.42	18,624,090.16
——股票投资	-28,084,648.42	18,624,090.16
——债券投资	-	-

——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-28,084,648.42	18,624,090.16

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
基金赎回费收入	259,902.95	217,087.61
合计	259,902.95	217,087.61

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
交易所市场交易费用	214,260.33	231,227.87
银行间市场交易费用	-	-
合计	214,260.33	231,227.87

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	4,794.45	5,376.00
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
开户费	-	400.00
合计	604,794.45	605,776.00

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，每日计算，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季人民币 50,000.00 元。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司(″中国建设银行″)	基金托管人、基金销售机构
招商证券股份有限公司(″招商证券″)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时基金（国际）有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	-	-	2,980,756.00	1.95%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 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 12 月 31 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12月31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	1.65%	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,685,711.19	1,442,407.84
其中：支付销售机构的客户维护费	503,556.05	372,043.04

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	370,856.50	317,329.74

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	8,857,868.17	75,209.03	8,138,706.57	61,436.68

注：本基金的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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有 579,100 股托管人公司中国建设银行的 A 股普通股(2017 年 12 月 31 日：447,000 股)，成本总额为人民币 3,954,854.33 元(2017 年 12 月 31 日：2,520,757.05 元)，估值总额为人民币 3,688,867.00 元(2017 年 12 月 31 日：3,432,960.00 元)，占基金资产净值的比例为 2.32%(2017 年 12 月 31 日：2.46%)。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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	备注
601860	紫金银行	2018-12-20	2019-01-03	新股未上市	3.14	3.14	15,970.00	50,145.80	50,145.80	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2017 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司

可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资和资产支持证券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 12 月 31 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2018 年 12 月 31 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,857,868.17	-	-	-	8,857,868.17
结算备付金	10,743.94	-	-	-	10,743.94
存出保证金	13,776.04	-	-	-	13,776.04
交易性金融资产	-	-	-	151,109,158.32	151,109,158.32
应收证券清算款	-	-	-	40,214.48	40,214.48
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,154.44	2,154.44
应收申购款	-	-	-	70,137.63	70,137.63
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,882,388.15	-	-	151,221,664.87	160,104,053.02
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	338,935.62	338,935.62
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	140,884.26	140,884.26
应付托管费	-	-	-	30,994.57	30,994.57
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	102,051.26	102,051.26
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	391,261.39	391,261.39
负债总计	-	-	-	1,004,127.10	1,004,127.10
利率敏感度缺口	8,882,388.15	-	-	150,217,537.77	159,099,925.92
上年度末 2017 年 12 月 31 日	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
银行存款	8,138,706.57	-	-	-	8,138,706.57
结算备付金	17,906.25	-	-	-	17,906.25
存出保证金	14,407.10	-	-	-	14,407.10
交易性金融资产	-	-	-	132,206,528.25	132,206,528.25
应收证券清算款	-	-	-	286,420.49	286,420.49
应收利息	-	-	-	1,751.67	1,751.67

应收申购款	-	-	-	195,086.85	195,086.85
资产总计	8,171,019.92	-	-	132,689,787.26	140,860,807.18
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4.00	4.00
应付赎回款	-	-	-	632,781.23	632,781.23
应付管理人报酬	-	-	-	119,469.81	119,469.81
应付托管费	-	-	-	26,283.34	26,283.34
应付交易费用	-	-	-	37,725.46	37,725.46
其他负债	-	-	-	292,008.37	292,008.37
负债总计	-	-	-	1,108,272.21	1,108,272.21
利率敏感度缺口	8,171,019.92	-	-	131,581,515.05	139,752,534.97

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资(2017 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的比例为 90%～95%，其中，中证银行指数成分股和备选成分股占基金非现金资产的比例不低于 80%；债券、货币市场工具、现金、权证、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具及其他资产占基金资产的 5%～10%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%～3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行

风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	151,109,158.32	94.98	132,206,528.25	94.60
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
合计	151,109,158.32	94.98	132,206,528.25	94.60

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 748	增加约 662
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 748	减少约 662

7.4.14 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 12 月 31 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 151,059,012.52 元，属于第二层次的余额为 50,145.80 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，无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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 12 月 31 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	151,109,158.32	94.38
	其中：股票	151,109,158.32	94.38
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	8,868,612.11	5.54
8	其他各项资产	126,282.59	0.08

9	合计	160,104,053.02	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	66,039.50	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	151,043,118.82	94.94
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	-	-
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	151,109,158.32	94.98

8.2.2 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。

8.3 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

8.3.1 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	842,059	21,219,886.80	13.34
2	601166	兴业银行	1,075,500	16,067,970.00	10.10
3	601328	交通银行	2,381,400	13,788,306.00	8.67

4	600016	民生银行	2,147,100	12,302,883.00	7.73
5	601288	农业银行	3,303,300	11,891,880.00	7.47
6	600000	浦发银行	1,010,348	9,901,410.40	6.22
7	601398	工商银行	1,859,800	9,838,342.00	6.18
8	601169	北京银行	1,273,754	7,145,759.94	4.49
9	000001	平安银行	745,060	6,988,662.80	4.39
10	601988	中国银行	1,817,400	6,560,814.00	4.12
11	601229	上海银行	477,756	5,346,089.64	3.36
12	601818	光大银行	1,373,080	5,080,396.00	3.19
13	600015	华夏银行	555,564	4,105,617.96	2.58
14	601939	建设银行	579,100	3,688,867.00	2.32
15	002142	宁波银行	223,496	3,625,105.12	2.28
16	600919	江苏银行	598,700	3,574,239.00	2.25
17	601009	南京银行	512,516	3,310,853.36	2.08
18	601998	中信银行	267,700	1,458,965.00	0.92
19	600926	杭州银行	177,300	1,312,020.00	0.82
20	601997	贵阳银行	118,900	1,269,852.00	0.80
21	601128	常熟银行	96,900	594,966.00	0.37
22	002839	张家港行	80,700	431,745.00	0.27
23	600908	无锡银行	81,100	424,964.00	0.27
24	002807	江阴银行	77,800	395,224.00	0.25
25	603323	吴江银行	63,900	390,429.00	0.25
26	601838	成都银行	34,500	277,725.00	0.17
27	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.04
28	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.03

8.3.2 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	14,683,073.73	10.51
2	601166	兴业银行	10,291,276.00	7.36
3	600016	民生银行	9,074,970.00	6.49
4	601328	交通银行	8,480,328.07	6.07
5	601288	农业银行	7,578,912.00	5.42
6	601398	工商银行	6,942,585.64	4.97
7	600000	浦发银行	6,665,163.72	4.77
8	601229	上海银行	5,584,111.10	4.00

9	000001	平安银行	4,995,826.98	3.57
10	601169	北京银行	4,801,158.85	3.44
11	601988	中国银行	4,282,729.00	3.06
12	601818	光大银行	3,267,409.00	2.34
13	601939	建设银行	3,063,459.00	2.19
14	601009	南京银行	2,935,193.91	2.10
15	600015	华夏银行	2,770,602.92	1.98
16	002142	宁波银行	2,402,039.55	1.72
17	600919	江苏银行	2,376,855.13	1.70
18	600926	杭州银行	1,498,568.00	1.07
19	601998	中信银行	989,053.00	0.71
20	601997	贵阳银行	968,873.45	0.69

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。

8.4.2 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	9,069,647.23	6.49
2	600016	民生银行	6,506,511.75	4.66
3	601166	兴业银行	5,587,369.68	4.00
4	601328	交通银行	4,604,442.00	3.29
5	601288	农业银行	3,890,663.00	2.78
6	601398	工商银行	3,638,744.00	2.60
7	600000	浦发银行	3,581,785.75	2.56
8	000001	平安银行	2,607,928.50	1.87
9	601169	北京银行	2,456,335.96	1.76
10	601988	中国银行	2,298,676.00	1.64
11	601939	建设银行	1,731,930.00	1.24
12	601818	光大银行	1,724,809.00	1.23
13	600015	华夏银行	1,470,994.12	1.05
14	601009	南京银行	1,309,272.00	0.94
15	002142	宁波银行	1,280,879.00	0.92
16	600919	江苏银行	1,163,742.00	0.83
17	601229	上海银行	1,022,824.00	0.73
18	603259	药明康德	583,190.41	0.42
19	601997	贵阳银行	518,964.00	0.37
20	601998	中信银行	510,592.00	0.37

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。

8.4.3 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	107,960,390.95
卖出股票的收入（成交）总额	60,405,000.42

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	13,776.04
2	应收证券清算款	40,214.48
3	应收股利	-
4	应收利息	2,154.44
5	应收申购款	70,137.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	126,282.59

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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		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
博时银行分级基金	12,114	12,549.21	321,453.00	0.21%	151,699,676.05	99.79%
博时银行分级基金 A	106	143,789.18	7,006,065.00	45.97%	8,235,588.00	54.03%
博时银行分级基金 B	234	65,135.27	785,201.00	5.15%	14,456,452.00	94.85%
合计	12,454	14,654.28	8,112,719.00	4.45%	174,391,716.05	95.55%

9.2 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	24.64%
2	余晓敏	1,406,448.00	9.23%
3	招商财富－招商银行－招商财富－铂润 3 号债券套利专项资产管理计划	1,159,300.00	7.61%
4	北京无隅资产管理有限公司－无隅磐石一号私募投资基金	1,148,201.00	7.53%
5	中量投资产管理有限公司－中量投优选 1 号私募基金	983,455.00	6.45%
6	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	5.05%
7	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	4.59%
8	中国银河证券股份有限公司	599,990.00	3.94%
9	中量投资产管理有限公司－中量投全天候 1 号私募基金	500,000.00	3.28%
10	招商财富-招商银行-招商财富-铂润 4 号债券套利专项资产管理计划	424,500.00	2.79%

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	2,446,176.00	16.05%
2	伍兰佳	1,765,901.00	11.59%
3	赵冬	1,166,700.00	7.65%

4	芮根火	1,114,883.00	7.31%
5	范正荣	1,000,035.00	6.56%
6	李永泉	873,426.00	5.73%
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	5.05%
8	芮健平	737,134.00	4.84%
9	魏舒力	593,515.00	3.89%
10	吴敏	450,756.00	2.96%

9.3 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	297,854.14	0.20%
	博时银行分级基金 A	-	-
	博时银行分级基金 B	-	-
	合计	297,854.14	0.16%

9.4 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	10~50
	博时银行分级基金 A	-
	博时银行分级基金 B	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	博时银行分级基金	10~50
	博时银行分级基金 A	-
	博时银行分级基金 B	-
	合计	10~50

§10 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	246,190,124.92	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	207,545,553.81	-	-

本报告期基金拆分变动份额	8,226,174.20	-1,671,392.00	-1,671,392.00
本报告期期末基金份额总额	152,021,129.05	15,241,653.00	15,241,653.00

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。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 40000 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
第一创业	1	-	-	-	-	减少 1 个
上海证券	1	-	-	-	-	-

长江证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	79,122,932.17	47.44%	73,671.46	52.98%	-
东北证券	1	41,396,141.80	24.82%	30,276.25	21.77%	新增 1 个
平安证券	1	31,621,792.73	18.96%	23,124.36	16.63%	新增 1 个
中金公司	1	6,308,145.75	3.78%	5,877.21	4.23%	-
天风证券	1	6,111,133.28	3.66%	4,469.88	3.21%	-
兴业证券	1	2,225,795.74	1.33%	1,628.06	1.17%	-

11.7.2 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
第一创业	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中投证券	3,199,680.00	100.00%	10,000,000.00	100.00%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	20181228 关于博时旗下部分基金参加工行定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-12-28
2	关于博时旗下部分开放式基金增加北京百度百盈基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-12-28
3	关于博时旗下部分开放式基金增加上海联泰资产管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-12-12
4	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加上海浦东发展银行股份有限公司基金业务双十二费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-12-11
5	关于博时中证银行指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-12-05
6	关于博时中证银行指数分级证券投资基金定期份额折算前收盘价调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-12-05
7	博时中证银行指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间银行 A 类份额停复牌的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-12-04
8	博时中证银行指数分级证券投资基金办理定期折算业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-11-28
9	博时中证银行指数分级证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-10-25
10	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购及定投业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-09-29
11	关于博时旗下部分开放式基金增加中民财富基金销售（上海）有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-09-27
12	关于博时旗下部分开放式基金增加民商基金销售（上海）有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-09-25
13	博时中证银行指数分级证券投资基金 2018 年半年度报告（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-08-29
14	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）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-08-29
15	关于博时旗下部分开放式基金增加凤凰金信（银川）基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-08-02

16	博时中证银行指数分级证券投资基金更新招募说明书 2018 年第 2 号（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-07-24
17	博时中证银行指数分级证券投资基金更新招募说明书 2018 年第 2 号（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-07-24
18	博时中证银行指数分级证券投资基金 2018 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-07-20
19	20180629 关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购及定投业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-29
20	20180509 关于博时旗下部分开放式基金增加福建海峡银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-05-09
21	博时中证银行指数分级证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-04-20
22	20180413 关于博时旗下部分开放式基金增加深圳盈信基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-04-13
23	博时中证银行指数分级证券投资基金 2017 年年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-31
24	博时中证银行指数分级证券投资基金 2017 年年度报告（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-31
25	20180330 关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购及定投业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-30
26	博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-27
27	博时中证银行指数分级证券投资基金托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-27
28	流动性风险管理规定：博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同和托管协议修改前后文对照表	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-24
29	关于博时基金管理有限公司根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》变更旗下部分基金法律文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-24
30	关于博时旗下部分开放式基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-21
31	关于博时旗下部分开放式基金增加上海挖财金融信息服务有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-20
32	20180201 关于博时旗下部分基金增加南京银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-02-01
33	博时中证银行指数分级证券投资基金招募说明书 2018 年第 1 号(摘要)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-23

34	博时中证银行指数分级证券投资基金招募说明书 2018 年第 1 号(正文)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-23
35	博时中证银行指数分级证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-20

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

13.1.1 中国证监会批准博时中证银行指数分级证券投资基金设立的文件

13.1.2 《博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同》

13.1.3 《博时中证银行指数分级证券投资基金托管协议》

13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

13.1.5 博时中证银行指数分级证券投资基金各年度审计报告正本

13.1.6 报告期内博时中证银行指数分级证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇一九年三月二十九日