

博时中证银行指数证券投资基金（LOF）
（原博时中证银行指数分级证券投资基金）

2020 年第 3 季度报告
2020 年 9 月 30 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：二〇二〇年十月二十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2020 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 博时中证银行指数证券投资基金（LOF）（转型后）

基金简称	博时中证银行指数
场内简称	银行 LOF
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	2020 年 8 月 6 日
报告期末基金份额总额	240,333,993.66 份
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	本基金为指数型基金，采用完全复制法，按照成份股在中证银行指数中的基准权重构建指数化投资组合，同时为实现对标的指数更好的跟踪，本基金将辅以适当的替代性策略调整组合。
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

	基金当中中高预期风险、中高预期收益的品种。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。
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

2.2 博时中证银行指数分级证券投资基金（转型前）

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		
报告期末基金份额总额	210,978,776.25 份		
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。		
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		
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
下属分级基金的交易代码	160517	150267	150268
报告期末下属分级基金的份额总额	210,978,776.25 份	-份	-份
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

银行A、B份额于转型前最后一日（2020年8月5日）已全部转换为银行母份额，日终银行A、B份额余额均为0。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 博时中证银行指数证券投资基金（LOF）（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2020 年 8 月 6 日（基金合同生效日）-2020 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	3,847,817.67
2.本期利润	-803,521.62
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0035
4.期末基金资产净值	266,332,156.92
5.期末基金份额净值	1.1082

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。

所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。

3.1.2 博时中证银行指数分级证券投资基金（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2020 年 7 月 1 日-2020 年 8 月 5 日)
1.本期已实现收益	9,268,359.19
2.本期利润	6,871,032.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0381
4.期末基金资产净值	233,675,644.80
5.期末基金份额净值	1.1076

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。

所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 博时中证银行指数证券投资基金（LOF）（转型后）

（报告期：2020年8月6日-2020年9月30日）

3.2.1.1 本报告期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

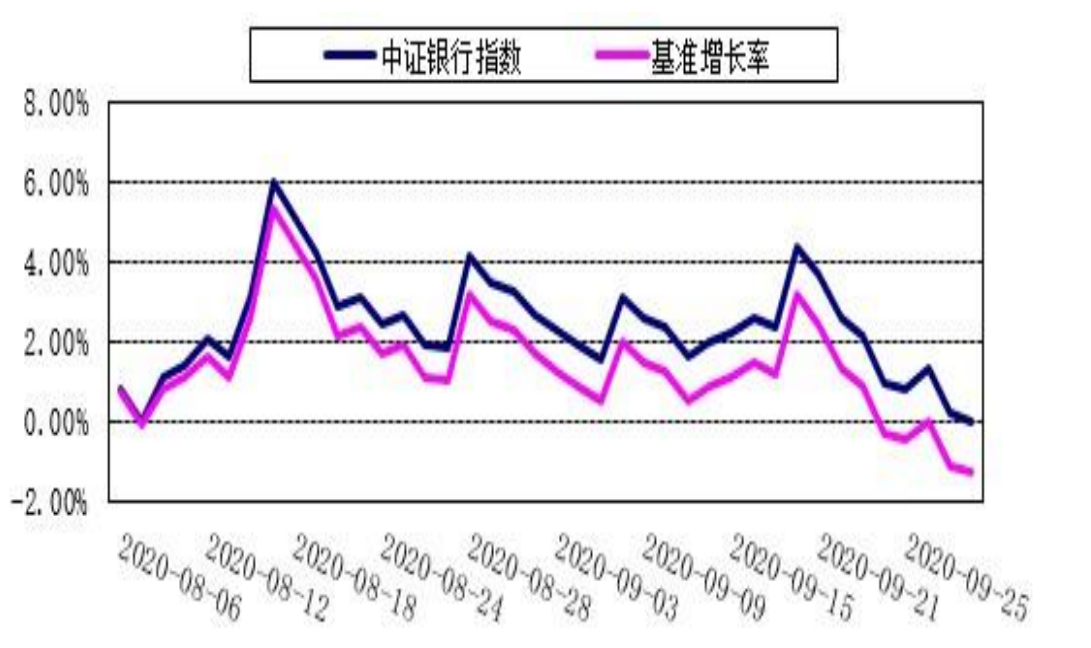
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

过去三个月	0.05%	0.95%	-1.27%	0.94%	1.32%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.05%	0.95%	-1.27%	0.94%	1.32%	0.01%

3.2.1.2 自基金转型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

博时中证银行指数证券投资基金（LOF）（转型后）

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
(2020 年 8 月 6 日至 2020 年 9 月 30 日)



注：本基金合同于 2020 年 8 月 6 日生效。按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十三部分“（二）投资范围”、“（四）投资限制”的有关约定。截止报告期末基金尚未完成建仓。

3.2.2 博时中证银行指数分级证券投资基金（转型前）

（报告期：2020年7月1日-2020年8月5日）

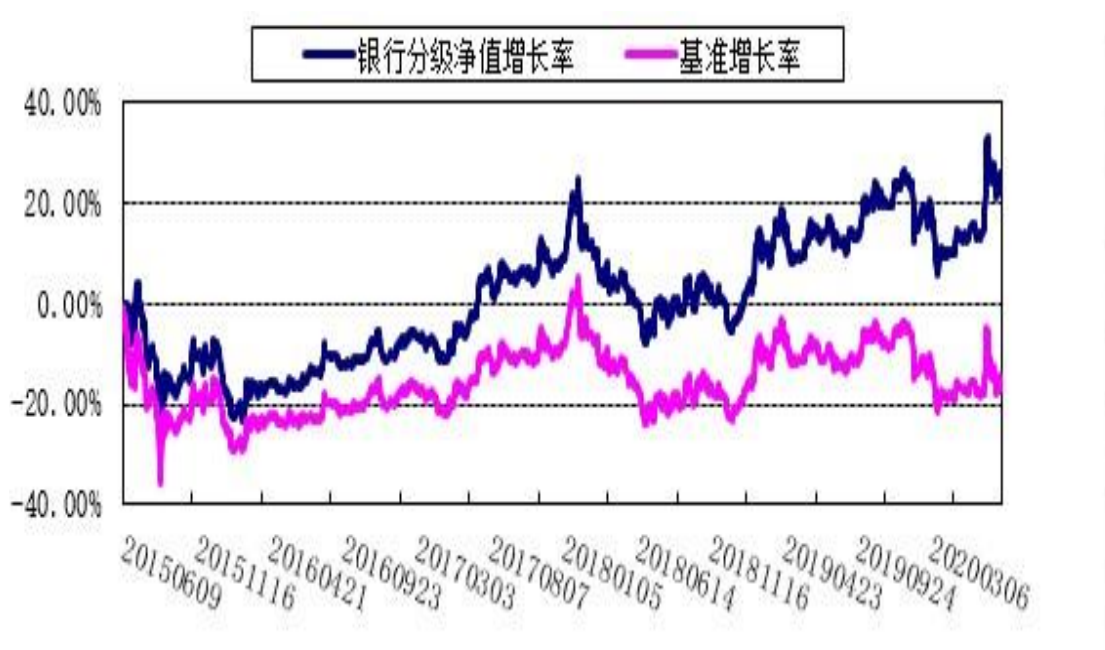
3.2.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	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 (20200 506-202 00805)	8.61%	1.48%	-0.21%	1.59%	8.82%	-0.11%

过去六个月 (20200206-20200805)	8.49%	1.36%	-2.56%	1.43%	11.05%	-0.07%
过去一年 (20190806-20200805)	10.91%	1.20%	-3.85%	1.24%	14.76%	-0.04%
过去三年 (20170806-20200805)	18.67%	1.17%	-5.55%	1.19%	24.22%	-0.02%
过去五年 (20150806-20200805)	39.52%	1.19%	4.24%	1.20%	35.28%	-0.01%
自基金合同生效起至今 (20150609-20200805)	24.65%	1.29%	-15.57%	1.31%	40.22%	-0.02%

3.2.2.2 自基金转型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（转型前）
 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 2020 年 8 月 5 日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

4.1.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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监/基金经理	2020-08-06	-	10.2	赵云阳先生, 硕士。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、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

				<p>券证券投资基金(2013 年 7 月 11 日-2018 年 1 月 26 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)、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)、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-2019 年 10 月 11 日)、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-2019 年 10 月 11 日)、博时中证银行指数分级证券投资基金(2015 年 10 月 8 日-2020 年 8 月 5 日)、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-2020 年 8 月 6 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时上证 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(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)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 9 月 20 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019 年 11 月 13 日—至今)、博时中证银行指数证券投资基金（LOF）(2020 年 8 月 6 日—至今)、博时中证全指证券公司指数证券投资基金(2020 年 8 月 7 日—至今)的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 9 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年三季度，海外主要市场指数有所分化，其中，标普 500 上涨 8.47%，纳斯达克上涨 11.02%，日经 225 上涨 4.02%，英国富时 100 下跌 4.92%，法国 CAC40 下跌 2.69%，德国 DAX 指数上涨 3.65%，香港恒生指数下跌 3.96%。国内 A 股方面，基本处于上涨态势。汇率方面，人民币大幅升值，季度涨 3.72%。债券市场方面，受经济活动好转预期影响，10 年期国债收益率季度上行 33 个 BP，当前收益率为 3.15。

行情方面，2020 年三季度主流指数全线上涨，偏大盘的上证 50 上涨 9.87%、沪深 300 指数上涨 10.17%，偏小盘的中证 500 上涨 5.58%，中证 1000 上涨 4.71%，创业板指在注册制的利好影响下上涨 5.60%。行业方面，中信一级行业中表现居前的是国防军工、消费者服务、电力设备及新能源、汽车、食品饮料，涨跌幅分别为 32.02%、26.56%、23.69%、20.42%、

19.37%，跌幅较为靠前的行业是通信、商贸零售、综合金融、计算机、传媒，跌幅分别为 8.03%、3.05%、2.37%、2.06%、1.70%。

展望 2020 年四季度，宏观层面，全球整体增长预期边际有所改善，但疫情仍未见明显好转，负面影响仍在。中美关系方面出现一些积极信号，如央视恢复转播 NBA 等情况，但台海风险在进一步上升。国内经济方面，据文旅部统计，8 天长假期间全国共接待国内游客 6.37 亿人次，同比恢复 79.0%；国内旅游收入 4665.6 亿元，同比恢复 69.9%，经济持续改善可期。货币政策仍将保持适度宽松，但边际上开始逐步回归常态，利率边际上升，未来估值的驱动力有限，盈利影响权重提升。

我们对 A 股中长期表现仍偏乐观，但需注意仓位的灵活性，把握结构性机会。风格上，结合经济修复，持续重视“风格再均衡”。在保持消费、医药、科技的配置的基础上，适当增持传统周期板块中的核心资产，特别是高股息低估值类资产。落实到具体板块，关注金融地产、建材、新能源汽车、光伏等板块，精选结构性机会。

在投资策略上，本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，紧密跟踪标的指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长，希望通过本基金为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 09 月 30 日，本基金份额净值为 1.1082 元，份额累计净值为 1.2472 元。报告期内，本基金由博时中证银行指数分级证券投资基金转型为博时中证银行指数证券投资基金。转型前，自 2020 年 5 月 6 日至 2020 年 8 月 5 日，博时中证银行指数分级证券投资基金份额净值增长率为 8.61%，同期业绩基准增长率-0.21%；转型后，自 2020 年 8 月 6 日至报告期末，博时中证银行指数证券投资基金份额净值增长率为 0.05%，同期业绩基准增长率-1.27%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 博时中证银行指数证券投资基金 (LOF) (转型后)

(报告期: 2020年8月6日-2020年9月30日)

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	252,505,735.13	93.34
	其中: 股票	252,505,735.13	93.34
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	15,888,243.78	5.87
8	其他资产	2,119,516.97	0.78
9	合计	270,513,495.88	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	824,461.50	0.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,029.12	0.00
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	16,376.68	0.01
J	金融业	-	-
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	141,056.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	66,153.27	0.02
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	1,061,076.57	0.40

5.1.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	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	-	-
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	251,444,658.56	94.41
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	251,444,658.56	94.41

5.1.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.1.3.1 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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	1,073,659	38,651,724.00	14.51
2	601166	兴业银行	1,527,500	24,638,575.00	9.25
3	601398	工商银行	4,295,200	21,132,384.00	7.93
4	000001	平安银行	1,269,060	19,251,640.20	7.23

5	601328	交通银行	3,367,100	15,286,634.00	5.74
6	600016	民生银行	2,607,500	13,819,750.00	5.19
7	600000	浦发银行	1,438,748	13,509,843.72	5.07
8	002142	宁波银行	378,096	11,902,462.08	4.47
9	601288	农业银行	3,521,000	11,161,570.00	4.19
10	601229	上海银行	1,218,673	9,919,998.22	3.72

5.1.3.2 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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688157	松井股份	1,804.00	171,614.52	0.06
2	688311	盟升电子	1,960.00	151,037.60	0.06
3	688222	成都先导	3,800.00	141,056.00	0.05
4	688505	复旦张江	6,090.00	131,361.30	0.05
5	688589	力合微	2,771.00	98,481.34	0.04

5.1.4 报告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。

5.1.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.1.7 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。

5.1.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.1.9 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。

5.1.10 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。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除招商银行(600036)、兴业银行(601166)、工商银行(601398)、平安银行(000001)、交通银行(601328)、民生银行(600016)、浦发银行(600000)、宁波银行(002142)、农业银行(601288)、上海银行(601229)的发行主体外，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。

主要违规事实：2020 年 8 月 25 日，因存在以信贷资金用作银行承兑汇票保证金，虚增存款的违规行为，中国银行保险监督管理委员会金华监管分局对招商银行股份有限公司金华分行处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2019 年 10 月 18 日，因存在严重违反审慎经营规则办理票据业务的违规行为，中国银行业监督管理委员会辽宁监管局对兴业银行股份有限公司沈阳分行处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020 年 5 月 9 日，因工商银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在理财产品数量漏报、资金交易信息漏报严重、信贷资产转让业务漏报等违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会对中国工商银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020 年 2 月 3 日，因存在汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成、代理保险销售的人员为非商业银行人员、汽车消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平等违规行为，中国银行业监督管理委员会深圳监管局对平安银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020 年 5 月 9 日，因交通银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在理财产品数据漏报、资金交易信息漏报严重等违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020 年 2 月 14 日，因存在未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告等违规行为，中国人民银行对中国民生银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020 年 8 月 11 日，因该行在 2013 年至 2018 年，存在 1.未按专营部门制规定开展同业业务；2.同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；3.延迟支付同业投资资金吸收存款等违规行为，中国保险监督管理委员会上海保监局对上海浦东发展银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2019 年 12 月 5 日，因存在设立时点性规模考核指标，股权质押管理不合规等违规行为，宁波银保监局对宁波银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020 年 5 月 9 日，因存在“两会一层”境外机构管理履职不到位、国别风险管理不满足监管要求、信贷资金被挪用作保证金等违规行为，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2019 年 11 月 14 日，因存在违反支付业务规定的违规行为，中国人民银行上海总部对上海银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

对该证券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。

5.1.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	35,232.50
2	应收证券清算款	141,959.45
3	应收股利	-
4	应收利息	1,554.07
5	应收申购款	1,940,770.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,119,516.97

5.1.11.4 报告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。

5.1.11.5 报告期末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。

5.1.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688157	松井股份	171,614.52	0.06	首次公开发行限售
2	688311	盟升电子	151,037.60	0.06	首次公开发行限售
3	688222	成都先导	141,056.00	0.05	首次公开发行限售
4	688505	复旦张江	131,361.30	0.05	首次公开发行限售
5	688589	力合微	98,481.34	0.04	首次公开发行限售

5.1.11.6 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。

5.2 博时中证银行指数分级证券投资基金（转型前）

（报告期：2020年7月1日-2020年8月5日）

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	221,003,556.40	93.03
	其中：股票	221,003,556.40	93.03
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	16,456,946.85	6.93
8	其他各项资产	100,573.51	0.04
9	合计	237,561,076.76	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,835,134.87	0.79
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	11,905.61	0.01
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	-	-
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	175,902.00	0.08

N	水利、环境和公共设施管理业	76,072.27	0.03
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	2,099,014.75	0.91

5.2.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	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	-	-
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	218,904,541.65	93.68
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	218,904,541.65	93.68

5.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.2.3.1 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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	919,159	33,365,471.70	14.28
2	601166	兴业银行	1,320,000	20,988,000.00	8.98
3	601398	工商银行	3,711,900	18,559,500.00	7.94
4	000001	平安银行	1,027,560	14,139,225.60	6.05
5	601328	交通银行	2,909,800	13,908,844.00	5.95
6	600000	浦发银行	1,243,348	13,067,587.48	5.59
7	600016	民生银行	2,253,300	12,595,947.00	5.39
8	601288	农业银行	3,042,800	9,858,672.00	4.22
9	002142	宁波银行	318,096	9,689,204.16	4.15
10	601229	上海银行	1,053,173	8,772,931.09	3.75

5.2.3.2 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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601336	新华保险	4,000.00	228,600.00	0.10
2	688311	盟升电子	1,960.00	213,561.60	0.09
3	688185	康希诺	933.00	195,659.43	0.08
4	688222	成都先导	3,800.00	175,902.00	0.08
5	688080	映翰通	2,144.00	171,198.40	0.07

5.2.4 报告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。

5.2.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.2.7 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。

5.2.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.9 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。

5.2.10 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。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除招商银行(600036)、兴业银行(601166)、工商银行(601398)、平安银行(000001)、交通银行(601328)、浦发银行(600000)、民生银行(600016)、农业银行(601288)、宁波银行(002142)、上海银行(601229)的发行主体外，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。

主要违规事实：2020年8月25日，因存在以信贷资金用作银行承兑汇票保证金，虚增存款的违规行为，中国银行保险监督管理委员会金华监管分局对招商银行股份有限公司金华分行处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2019年10月18日，因存在严重违反审慎经营规则办理票据业务的违规行为，中国银行业监督管理委员会辽宁监管局对兴业银行股份有限公司沈阳分行处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020年5月9日，因工商银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在理财产品数量漏报、资金交易信息漏报严重、信贷资产转让业务漏报等违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会对中国工商银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020年2月3日，因存在汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成、代理保险销售的人员为非商业银行人员、汽车消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平等违规行为，中国银行业监督管理委员会深圳监管局对平安银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020年5月9日，因交通银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在理财产品数据漏报、资金交易信息漏报严重等违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020年8月11日，因该行在2013年至2018年，存在1.未按专营部门制规定开展同业业务；2.同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；3.延迟支付同业投资资金吸收存款等违规行为，中国保险监督管理委员会上海保监局对上海浦东发展银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020年2月14日，因存在未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告等违规行为，中国人民银行对中国民生银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020年5月9日，因存在“两会一层”境外机构管理履职不到位、国别风险管理不满足监管要求、信贷资金被挪用作保证金等违规行为，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2019年12月5日，因存在设立时点性规模考核指标，股权质押管理不合规等违规行为，宁波银保监局对宁波银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2019年11月14日，因存在违反支付业务规定的违规行为，中国人民银行上海总部对上海银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

对该证券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。

5.2.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	31,434.33
2	应收证券清算款	57,668.76
3	应收股利	-
4	应收利息	11,470.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	100,573.51

5.2.11.4 报告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。

5.2.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.2.11.5.1 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。

5.2.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产 净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688311	盟升电子	213,561.60	0.09	首次公开发行限售
2	688185	康希诺	195,659.43	0.08	首次公开发行限售
3	688222	成都先导	175,902.00	0.08	首次公开发行限售
4	688080	映翰通	171,198.40	0.07	首次公开发行限售

5.2.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

6.1 博时中证银行指数证券投资基金（LOF）

单位：份

基金合同生效日的基金份额总额	210,978,776.25
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	100,127,541.46
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	70,772,324.05
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	240,333,993.66

注：根据 2020 年 7 月 2 日发布的《博时基金管理有限公司关于博时中证银行指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，博时中证银行指数分级证券投资基金将从 2020 年 7 月 2 日开始进入选择期，选择期为 2020 年 7 月 2 日至 2020 年 8 月 3 日。2020 年 8 月 6 日起博时中证银行指数分级证券投资基金将转型为博时中证银行指数证券投资基金，《博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同》失效，《博时中证银行指数证券投资基金基金合同》生效。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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 2020 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理 233 只公募基金，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、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 12159 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 3655 亿元人民币，累计分红逾 1335 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。

2020 年 9 月 22 日，由《投资时报》及标点财经研究院联合主办的“见未来 2020 第三届资本市场高峰论坛暨金禧奖年度颁奖盛典”在京举办，凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金荣获三项大奖。博时获评“金禧奖 2020 卓越公募基金公司”、“金禧奖 2020 优秀固收类基金团队”、“金禧奖 2020 大湾区特别贡献奖”。

2020 年 9 月 15 日，《上海证券报》第十七届“金基金”奖颁奖典礼在上海隆重举办，凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金及子公司博时资本共荣获三项大奖。博时基金荣获 2019 年度金基金·海外投资回报基金管理公司奖。博时旗下基金产品博时新起点灵活配置混合型证券投资基金获得 2019 年度金基金·灵活配置型基金三年期奖。博时资本张存相荣获“金阳光·三年卓越私募基金经理（MOM 类）”奖项。

2020 年 8 月 6 日，《经济观察报》“见圳四十年---深圳经济特区成立 40 周年特别盛典”在深圳举办，博时基金荣获“致敬深圳经济特区成立四十周年卓越企业”奖项。

2020 年 7 月 9 日，新浪财经“2020 中国基金业开放与发展高峰论坛暨基金业致敬资本市场 30 周年峰会”在云端举办，届时公布了 2020 中国基金业金麒麟奖，博时基金荣获“2020 十大风云基金公司”，此外，博时基金王俊荣获“2020 最受青睐股票基金经理”奖项，博时基金赵云阳、桂征辉、王祥均荣获“2020 最受青睐指数与 ETF 基金经理”奖项。

2020 年 6 月 29 日，《证券时报》第十五届中国基金业明星基金奖榜单公布，博时基金共荣获三项大奖，旗下产品博时外延增长主题混合与博时宏观回报债券分别拿下“三年持续回报平衡混合型明星基金”与“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。博时信用债券基金摘得“十年持续回报债券型明星基金”奖。

2020 年 4 月 1 日，博时基金及子公司博时国际荣获《亚洲资产管理》2020“Best of the Best Awards”三项大奖。博时基金董事长兼总经理江向阳荣获“中国年度最佳 CEO”（Winner, China CEO of the Year-Jiang Xiangyang），博时基金（国际）有限公司荣获“香港最佳中资基金公司”（Winner, Hong Kong Best China Fund House），博时信用债基金荣获“中国在岸人民币债券最佳业绩（5 年）”（Winner, CNY Bonds, Onshore 5 Years-Bosera Credit Bond Fund）。

2020 年 3 月 31 日，《中国证券报》第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，博时基金旗下绩优产品博时信用债纯债债券荣获“七年期开放式债券型持续优胜金牛基金奖”。

2020 年 3 月 26 日，Morningstar 晨星（中国）2020 年度基金评选结果揭晓，博时信用债券在参选的同类 428 只基金中脱颖而出，摘得晨星“2020 年度激进债券型基金奖”。

2020 年 1 月 10 日，新京报“开放 普惠 科技”2019 金融行业评选颁奖典礼在北京举办，

博时基金凭借在可持续发展金融方面的努力成果，荣获“2019 年度杰出社会责任影响力企业”。

2020 年 1 月 4 日，2020《财经》可持续发展高峰论坛暨长青奖典礼在北京举办，博时基金凭借在 ESG 投资及可持续发展金融推动方面的耕耘和成果，荣获“2020《财经》长青奖-可持续发展创新奖”。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证监会批准博时中证银行指数分级证券投资基金募集的文件
- 9.1.2 《博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时中证银行指数分级证券投资基金托管协议》
- 9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 9.1.5 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
- 9.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照
- 9.1.7 中国证监会批准博时中证银行指数证券投资基金（LOF）设立的文件
- 9.1.8 《博时中证银行指数证券投资基金（LOF）基金合同》
- 9.1.9 《博时中证银行指数证券投资基金（LOF）托管协议》

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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
二〇二〇年十月二十八日