博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

2016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:招商银行股份有限公司 报告送出日期:二〇一七年三月二十七日

§1 重要提示、

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于 2017 年 3 月 24 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	博时招财一号保本
基金主代码	001238
交易代码	001238
基金运作方式	契约型定期开放
基金合同生效日	2015年4月29日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,353,010,620.65 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在保障保本周期到期时本金安全的前提下,严格控制风险,追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合,利用组合保险技术,动态调整固定收益类资产与风险资产的投资比例,以确保基金在保本周期到期时,实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。
业绩比较基准	二年期银行定期存款收益率(税后)
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	张燕
	联系电话	0755-83169999	0755-83199084
	电子邮箱	service@boshra.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	95555
传真		0755-83195140	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.boshra.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§3 主要财务指标、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	2016年	2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
本期已实现收益	52,183,070.06	-27,210,701.15
本期利润	42,687,480.56	-16,683,749.71
加权平均基金份额本期利润	0.0315	-0.0123
本期基金份额净值增长率	3.14%	-1.20%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0185	-0.0201
期末基金资产净值	1,379,014,351.50	1,336,326,870.94
期末基金份额净值	1.019	0.988

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

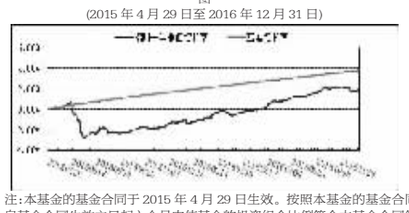
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.39%	0.07%	0.53%	0.01%	-0.14%	0.06%
过去六个月	1.70%	0.06%	1.06%	0.01%	0.64%	0.05%
过去一年	3.14%	0.07%	2.10%	0.01%	1.04%	0.06%
自基金合同生效起至今	1.90%	0.09%	3.77%	0.01%	-1.87%	0.08%

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

博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金

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4月29日至2016年12月31日)

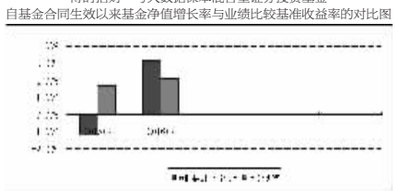


注:本基金的基金合同于 2015 年 4 月 29 日生效。按照本基金的基金合同规定, 自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十三条“(二)投资范围”、“(四)投资限制”的有关约定。

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

博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金

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:本基金合同于 2015 年 4 月 29 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 2016 年 12 月 31 日,博时基金公司共管理 164 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 6250 亿元人民币,其中公募基金规模逾 3760 亿元人民币,累计分红逾 781 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 2016 年年末,博时旗下共 94 只(份额分开计算)成立满一年的基金产品参与分类排名。其中排名在同类前 1/2 的产品共有 60 只(主动权益 17 只,债券 16 只,指数 20 只,货币 3 只,QDII 基金 4 只),约 64%;排名在前 1/3 的产品共有 45 只,约 48%;排名前 1/4 的产品共有 34 只,约 36%。博时旗下各类产品均有表现突出的产品位居行业前列。

黄金基金类,博时黄金 ETF(D 类)今年以来净值增长率 19.10%,在同类 8 只排名第 1。

固收方面,长期标准债券型基金里,博时双月薪定期支付债券,今年以来净值增长率为 6.54%,在同类 61 只中排名第 2;博时信用债纯债(A 类),今年以来净值增长率为 4.23%,在同类中排名第 4;中短期标准债券型基金,博时安盈债券(A 类)今年以来净值增长率为 2.02%,在同类 66 只排名第 1;普通债券型基金里,博时稳定价值债券(A 类)今年以来净值增长率为 2.31%,在同类排名前 1/3;货币市场基金里,博时外服货币今年以来净值增长率为 3.03%,同类 194 只排名第 6。

QDII 基金, 博时标普 500ETF 今年以来净值增长率 18.34%, 同类排名前 1/4。博时亚洲票息收益债券(QDII)今年以来净值增长率 14.43%,同类排名第 3。

2、其他大事件

·2016 年 12 月 27 日,2016 金融新媒体峰会暨金 V 榜 2016 颁奖典礼在广州举行,博时基金荣获“最具传播力基金公司”奖项。

·2016 年 12 月 13 日,由中国经营报主办的“2016 第十四届中国企业竞争力年会暨金融高峰论坛”在北京举行,博时基金荣获“2016 卓越竞争力品牌建设金融机构”奖项。

·2016 年 12 月 9 日,在证券日报主办的“第十二届中国证券市场年会”上,博时基金荣膺中国证券市场“2016 年度最全能公募基金龙鼎奖”。

·2016 年 12 月 8 日,金融界网站主办的首届智能金融国际论坛暨第五届金融界“领航中国”年度盛典,博时基金荣获“2016 年杰出品牌奖”。

·2016 年 12 月 6 日,全国社会保障基金理事会发布公告,博时成为基本养老保险基金首批证券投资管理机构之一。

·2016 年 12 月 1 日,由《经济观察报》主办的“2015-2016 年度观察家金融峰会”在沪举办,博时基金再次独家蝉联“卓越固定收益投资团队奖”。

·2016 年 11 月 25 日, 由北大汇丰商学院、南方都市报、奥一网联合主办的 2016 年(第二届)CFAC 中国金融年会在深召开,博时基金再次蝉联“年度最佳基金公司大奖”。

·2016 年 11 月 23 日,由新浪财经主办的“2016 新浪全球资产管理论坛”在京举行,“2016 中国(首届)波特菲勒奖综合评选” 结果揭晓。博时基金荣获“2016 最具互联网创新基金公司”、基金经理过钧获评 “2016 最佳债券基金经理”、何凯获“2016 最佳 ODII 基金经理”。本届波特菲勒奖博时基金共斩获三项大奖,成为获奖最多的公募基金公司之一。

·2016 年 11 月 17 日, 全国社保基金境内投资管理人 2016 年座谈会在上海举行,博时基金副总裁董良泓荣获“五年服务社保奖”,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 5 人,董良泓先生是自 2015 年之后再次蝉联该奖项。

·2016 年 9 月 7 日,第二届结构性融资与资产证券化论坛暨 2016 年度资产证券化·介甫奖颁奖典礼上,“博时资本 - 平安银行橙鑫橙 e 资产支持专项计划”荣获“应收账款类最受投资者欢迎产品”和“最佳风控产品”两项大奖。

·2016 年 8 月 5 日,由 21 世纪经济报道主办的“2016 深港通论坛暨‘金帆奖’系列颁奖礼上,博时一举斩获 2016 年综合实力十强基金公司奖、2016 年互联网突出表现奖、2016 年 ABS 最具实力管理人奖(博时资本)三项大奖。

·2016 年 6 月 24 日,由南方日报主办的一年一度“金榕奖”南方金融大奖系列评选正式揭晓, 博时基金董事长张光华荣膺 “2016 南方金融领导力年度大奖”,博时基金基金经理魏桢荣获“2016 南方金融年度投资理财师”称号。

·由中国基金报、香山财富论坛、深圳市政府金融办、国泰基金联合主办的“中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛”2016 年 5 月 13 日在深举行。博时旗下博时信用债券获得“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。

·2016 年 5 月 10 日,由上海证券报主办的 2016 中国基金业峰会暨第十三届“金基金”奖颁奖典礼在上海举办,博时基金荣获“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司”大奖。

·2016 年 4 月 15 日, 由中国基金报主办的第三届中国基金业英华奖评选揭晓,博时基金经理过钧先生获评三年期二级债基最佳基金经理、五年期二级债基最佳基金经理。

·2016 年 3 月 27 日,第十三届中国基金业金牛奖揭晓,博时基金摘得了基金业的“奥斯卡”奖 -- “固定收益投资金牛基金公司”奖。

·2016 年 3 月 15 日,由腾讯证券主办的《“挑战 机遇”315 评选——投资者最认同的券商、基金领军人物》评选活动日前揭晓,博时基金董事长张光华先生获评“投资者最认同的公募基金领军人物”,网络票选高居第二位。

·2016 年 1 月 18 日,大众证券报“2015 中国基金风云榜”上,博时创业成长(050014)荣获 2015 “最受投资者喜爱基金” 奖、博时安丰 18 个月定开债(160515)荣获 2015 “最佳固定收益型基金”奖。

·2016 年 1 月 15 日,2016 年金融理财创新与发展论坛暨第六届“金貔貅”奖颁奖在京举办,博时基金获评年度金牌品牌力、金牌创新力两项大奖;博时“存金宝”获年度金牌创新力金融产品奖。

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		
沙炜	基金经理	2015-08-04	-	8.5	2008年从中国科学院硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司,历任研究员、资深研究员、基金经理助理、研究部副总经理。现任博时丝路主题股票基金兼博时招财一号保本基金、博时招财二号保本基金的基金经理。
张李陵	基金经理	2016-08-01	-	4.5	2006年起先后在招商银行、融通基金工作。2014 年加入博时基金管理有限公司,历任投资经理、投资经理兼基金经理助理。现任博时稳定价值债券基金、博时平衡配置混合基金、博时信用债纯债债券基金、博时泰和债券基金、博时天颐债券基金、博时招财一号保本基金、博时招财二号保本基金的基金经理。
杨永光	股票投资部绝对收益组投资副总监/基金经理	2015-04-29	2016-08-01	15.2	1993年至 1997 年先后在桂林电器科学研究所、武汉迈瑞生物医疗电子股份公司工作。2001 年起在国海证券历任债券研究员、债券投资经理助理、高级投资经理、投资主办人。2011年加入博时基金管理有限公司,历任博时稳定价值债券基金、上证企债30ETF 基金、博时天颐债券基金、博时招财一号保本基金、博时新机遇混合基金的基金经理。固定收益总部公募基金组投资副总监。现任股票投资部绝对收益组投资副总监兼博时优势收益信用债债券基金、博时瑞盈保本混合基金、博时保泽保本混合基金、博时景兴纯债债券基金、博时保丰保本混合基金、博时保泰保本混合基金、博时招财二号保本基金、博时富安纯债债券基金、博时富益纯债债券基金、博时臻选纯债债券基金、博时富华纯债债券基金、博时泰安债券基金、博时鑫丰混合基金的基金经理。
赵云阳	基金经理	2015-04-29	2016-05-30	6.3	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、博时招财一号保本基金、博时中证海金大数据 100 基金、博时沪深 300 指数基金基金经理。现任博时深证基本面 200ETF 基金兼博时深证基本面 200ETF 联接基金、上证企债 30ETF 基金、博时证券保险指数分级基金、博时黄金 ETF 基金、博时上证 50ETF 基金、博时上证 50ETF 联接基金、博时银行分级基金、博时黄金 ETF 联接基金的基金经理。

注:上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《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,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

2016 年资本市场跌宕起伏,债券收益率也大幅波动。一季度初,随着外汇占款的大幅流出, 市场对中国经济的不利预期达到极致, 大幅降准的预期也被推到极致。但是,随着天量信贷和刺激正常的出台,加上过剩产能的逐步出清,需求和复苏两股力量共同作用,让经济出现了温和复苏。虽然 4 月份权威人士的讲话一度中断了这种预期,但三季度和四季度的数据仍然亮眼,显示出实体经济较强的韧性。

在这种格局下,债券收益率的走势耐人寻味。收益率倒在一季度到达较低的水平后,2 月份开始一度跟随基本面反弹;而 4 月权威人士讲话后,在金融扩张的推动下,收益率又在三季度再次走出了一波下行行情;直到四季度政策定调,要逆转金融扩张的趋势,债券收益率开始才大幅上行。操作上,组合把握住了二、三季度金融扩张的时点,拉长了久期,同时在 10 月份预判到了央行政策变化的可能,降低了久期。获得了超额收益

。

报告期内本基金权益部分以绝对收益为目标,采取低仓位和高周转策略,精选行业和主题,积极参与市场石倒机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日, 本基金份额净值为 1.019 元, 累计份额净值为 1.019 元,报告期内净值增长率为 3.14%,同期业绩基准涨幅为 2.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年大概率是防守反击的一年。过去 3 年货币稳增长取得了一定的成功。政府顺着库存周期加大了货币政策的力度, 经济自 16 年开始呈现弱复苏状态,但本轮资产价格的变动超过了过去几轮周期,无论是房价上涨、工业品上涨还是汇率贬值,都说明本轮货币稳增长的政策需要阶段性调整。

政策能够短期改变周期,却无法长期逆转周期。由于中国和美国暂时仍处于复苏周期中,政策利率的上行可能无法迅速改变经济走稳的节奏,债券市场可能短期承压。然而,本轮复苏的基础并不稳固,全球都难以找到新的增长点,因此一旦经济开始下行,我们将面临信用收缩和经济下行的双重压力,届时货币政策可能出现大幅的变化,债券市场的系统性机会也将重现。组合将密切关注各项指标,捕捉这一拐点。

展望 2017 年,国内经济增长惯性仍在,但货币和地产政策趋严,海外宏观政治不确定性增加, 料 A 股将延续震荡格局。考虑到本基金将于 2017 年 4 月底到期,未来将继续保持低仓位和高周转的绝对收益策略。

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。

2016 年,我公司根据法律、法规的规定,制定、修订和完善了《博时货币市场基金投资管理制度》、《博时基金国债期货投资管理流程手册》、《博时基金国债期货风险管理流程手册》、《博时基金流动性风险管理制度》、《关联交易管理办法》、《交易部公平交易管理制度》、《博时 ETF 基金风险管理制度》、《博时基金反洗钱工作手册》、《开放式基金业务规则》等制度和流程手册等制度。定期更新了各公募基金的《投资管理细则》,以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断完善“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: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。

4.8 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:本基金仅采取现金分红一种收益分配方式,不进行红利再投资;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容,可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金

报告截止日:2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产:	-	-
银行存款	457,366,886.23	143,195,765.23
结算备付金	549,053.32	1,813,305.63
存出保证金	182,280.01	324,554.51
交易性金融资产	907,181,097.59	1,035,941,199.97
其中:股票投资	20,083,597.59	29,154,799.97
基金投资	-	-
债券投资	887,097,500.00	1,006,786,400.00
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	-	150,000,545.00
应收证券清算款	-	180,000,000.00
应收利息	15,415,178.03	14,211,005.71
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,380,694,495.18	1,525,486,376.05
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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	-	180,000,000.00
应付证券清算款	-	7,397,067.90
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	934,444.05	904,546.88
应付托管费	175,208.22	169,602.56
应付销售服务费	116,805.50	113,068.36
应付交易费用	253,685.91	410,219.41
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	200,000.00	165,000.00
负债合计	1,680,143.68	189,159,505.11
所有者权益:	-	-
实收基金	1,353,010,620.65	1,353,010,620.65
未分配利润	26,003,730.85	-16,683,749.71
所有者权益合计	1,379,014,351.50	1,336,326,870.94
负债和所有者权益总计	1,380,694,495.18	1,525,486,376.05

注:1.报告截止日 2016 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.019 元,基金份额总额 1,353,010,620.65 份。

7.2 利润表

会计主体:博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金

本报告期:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一.收入	59,987,723.25	-3,541,322.62
1.利息收入	46,991,010.34	26,459,873.02
其中:存款利息收入	4,351,040.63	7,509,989.17
债券利息收入	42,496,084.54	16,599,644.06
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	143,885.17	2,350,239.79
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	22,492,302.41	-40,528,147.08
其中:股票投资收益	21,998,892.51	-41,341,211.25
基金投资收益	-	-
债券投资收益	372,081.16	541,097.98
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	121,328.74	271,966.19
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-9,495,589.50	10,526,951.44
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	-
减:二.费用	17,300,242.69	13,142,427.09
1. 管理人报酬	10,870,219.85	7,185,386.80
2. 托管费	2,038,166.23	1,347,260.06
3. 销售服务费	1,358,777.52	898,173.44
4. 交易费用	2,090,715.48	2,040,914.23
5. 利息支出	497,848.61	1,356,617.56
其中:卖出回购金融资产支出	497,848.61	1,356,617.56
6. 其他费用	444,515.00	314,075.00
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)	42,687,480.56	-16,683,749.71
减:所得税费用	-	-
四.净利润(净亏损以“-”号填列)	42,687,480.56	-16,683,749.71

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金

本报告期:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	1,353,010,620.65	-16,683,749.71	1,336,326,870.94
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	42,687,480.56	42,687,480.56
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四.本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五.期末所有者权益(基金净值)	1,353,010,620.65	26,003,730.85	1,379,014,351.50
项目	上年度可比期间 2015年4月29日(基金合同生效日)至2015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)	1,353,010,620.65	-	1,353,010,620.65
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-16,683,749.71	-16,683,749.71
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四.本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五.期末所有者权益(基金净值)	1,353,010,620.65	-16,683,749.71	1,336,326,870.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 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的负责人:王德英会计机构负责人:成江

7.4 报表附注

7.4.1 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一致。

7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》,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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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 。

(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。

7.4.3 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、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人的股东
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
天津通信集团有限公司	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:1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年4月29日(基金合同生效日)至2015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	669,591,352.42	42.67%	457,465,181.84	29.23%

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	6,992,892.84	40.97%	6,322,374.30	100.00%

7.4.4.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	1,046,000,000.00	92.90%	1,745,500,000.00	25.86%

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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	489,662.61	42.68%	140,627.86	55.67%
关联方名称	上年度可比期间 2015年4月29日(基金合同生效日)至2015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	331,943.64	29.44%	30,094.98	7.47%

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

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年4月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,870,219.85	7,185,386.80
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

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。

7.4.4.2.2