博时中证银行指数分级证券投资基金之银行A类份额和银行B类份额银行上市交易公告书

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
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2015年6月18日
公告日期：2015年6月15日

一、重要声明与提示

《博时中证银行指数分级证券投资基金之银行A类份额和银行B类份额上市交易公告书》（以下简称“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，博时中证银行指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和深圳证券交易所（以下简称“深交所”）对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告书未涉及的有关内容，请详细阅读刊登在2015年5月20日的《中国证券报》和5月25日《证券时报》上的《博时中证银行指数分级证券投资基金招募说明书》。，投资者亦可通过本公司网站或相关代销机构查阅相关资料。

二、基金概览

1、基金简称：博时银行指数分级基金
2、基金类型：股票型
3、基金运作方式：契约型开放式
4、本基金的基金份额包括博时银行分级证券投资基金之基础份额（场内简称：博时银行，基金代码：160517）、博时银行指数分级基金之A份额（场内简称：银行A类，基金代码：150267）、博时银行指数分级基金之B份额（场内简称：银行B类，基金代码：150268）。其中，银行A类份额、银行B类份额的基金份额配比始终保持1：1的比例不变。
5、本基金的存续期限为不定期。
6、博时银行指数分级证券投资基金之基础份额的申购和赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对本基金进行申购与赎回。场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位，具体销售网点和会员单位的名单由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。银行A类份额与银行B类份额只上市交易，不接受申购和赎回。
7、博时银行指数分级证券投资基金之基础份额的跨系统转托管：通过场内、场外方式认购本基金的基金份额持有人可以通过认购本基金的销售机构办理跨系统转托管业务。
8、份额配对转换是指博时银行份额与银行A类份额、银行B类份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括基金份额的分拆和合并两个方面。分拆是指基金份额持有人将其持有的场内博时银行份额按照2份场内博时银行份额对应1份银行A类份额与1份银行B类份额的比例进行转换的行为；基金份额的合并，指基金份额持有人将其持有的银行A类份额与银行B类份额按照1份银行A类份额与1份银行B类份额对应2份场内博时银行份额的比例进行转换的行为。

本基金的场内份额可以直接申请分拆与合并，场外份额通过跨系统转托管至场内后方可申请分拆与合并。

9、定期份额折算

定期折算基准日为本基金存续期内每个会计年度12月份的第一个工作日；若本基金在某定期折算基准日前1个月内发生过不定期折算，基金管理人可选择不进行该次定期折算，具体详见基金管理人届时发布的公告。

在基金份额折算前与折算后，银行A类份额与银行B类份额的份额配比保持1:1的比例。对于银行A类份额的约定应得收益，即银行A类份额每个定期折算基准日基金份额参考净值超出1.0000元部分，将折算为场内博时银行份额分配给银行A类份额持有人。博时银行份额持有人持有的每2份博时银行份额将按1份银行A类份额获得新增博时银行份额的分配。持有场外博时银行份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外博时银行份额的分配；持有场内博时银行份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内博时银行份额的分配。经过上述份额折算，银行A类份额的基金份额参考净值调整为1.0000元，博时银行份额的基金份额净值将相应调整。

10、不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即当博时银行B份额的份额参考净值小于等于0.2500或博时银行份额净值大于等于1.5000元人民币时，由基金管理人确定的基金份额折算日进行不定期份额折算。

当达到不定期折算条件时，本基金将分别对博时银行份额、银行A类份额、银行B类份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保银行A类份额与银行B类份额的比例为1:1，份额折算后博时银行份额的基金份额净值、银行A类份额与银行B类份额的基金份额参考净值均调整为1.0000元。

11、基金份额总额：截止2015年6月11日，本基金的基金份额总额为287,168,470.70份，其中，博时银行份额146,591,994.70份，银行A类份额为70,288,238.00份，银行B类份额为70,288,238.00份。

12、基金份额参考净值：截止2015年6月11日，博时银行份额的基金份额净值为1.0000元，银行A类份额的基金份额参考净值为1.0005元，银行B类份额的基金份额参考净值为0.9995元。

13、本次上市交易的基金份额简称：银行A类，基金代码：150267；银行B类，基金代码：150268.

14、本次上市交易的基金份额总额：银行A类70,288,238.00份，银行B类70,288,238.00份（截止2015年6月11日）

15、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
16、上市交易日期：2015年6月18日
17、基金管理人：博时基金管理有限公司
18、基金托管人：中国建设银行股份有限公司
19、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本次基金上市前的募集

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2015]757号
2、基金运作方式：契约型
3、基金合同期限：不定期
4、发售日期：自2015年5月25日起至2015年6月2日止
5、发售价格：1.00 元人民币
6、发售方式：交易所（场内）和柜台（场外）
7、发售机构：
（1）场外销售机构：
1）直销机构：博时基金管理有限公司直销中心
2）代销银行：建设银行、中国银行、交通银行、招商银行、上海浦东发展银行、平安银行、上海农村商业银行、东莞银行、汉口银行、东莞农村商业银行、河北银行、江苏银行、工商银行。
3）代销券商：中信证券、中信证券（山东）、中信证券（浙江）、中信建投、银河证券、信达证券、恒泰证券、方正证券、渤海证券、山西证券、西部证券、大同证券、江海证券、国都证券、中金公司民族证券、东北证券、第一创业、长城证券、安信证券、广州证券、万联证券、华福证券、世纪证券、中山证券、招商证券、华林证券、光大证券、申银万国、东海证券、上海证券、华鑫证券、华安证券、东吴证券、财富证券、德邦证券、海通证券、长江证券、国泰君安、国金证券、华泰证券、国信证券。
4）第三方销售机构：众禄基金、上海天天基金、好买基金、数米基金、一路财富、同花顺基金、恒天明泽基金。
（2）场内销售机构：
场内销售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位，具体名单可在深交所网站查询。
8、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司（特殊普通合伙）
9、募集资金总额及入账情况：本次基金发售确认的净认购金额为287,111,881.09元，认购款产生的利息为57,148.11元；上述资金及场外有效认购资金产生的利息50,113.61元已于2015年6月8日全额划入本基金在基金托管人处开立的基金托管专户；场内有效认购资金产生的利息7,034.50元将于下一银行结息日后划付至基金托管账户及结算备付金账户。

本基金通过场外、场内两种方式公开发售，本次募集有效认购总户数为5204户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，募集期募集资金及利息结转的基金份额共计287,168,470.70份，其中场外认购的基金份额为146,591,994.70份；场内认购的基金份额为140,576,476.00份。

10、本基金募集备案情况：根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，本基金募集结果符合备案条件，博时基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2015年6月9日获中国证监会书面确认，本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

11、基金合同生效日：2015年6月9日
12、基金合同生效日的基金份额总额：287,168,470.70份。
（二）基金上市交易的主要内容
1、本基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2015]275号
2、上市交易日期：2015年6月18日
3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、基础份额简称及代码：博时银行份额，场内简称：博时银行，基金代码：160517。

上市交易份额简称及代码：银行A类，基金代码：150267；银行B类，基金代码：150268。
5、本次上市交易份额：银行A类70,288,238.00份；银行B类70,288,238.00份（截止2015 年6月11日）。
6、基金资产净值的披露：开放式基金每日收市后对基金资产净值进行的估值

基金管理人每个开放日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所，深交所于次日通过行情系统“市盈率Ⅰ”揭示。根据《基金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人对公布的基金净值负责。

7、未上市交易份额的流通规定：对于托管在场内的博时银行份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为银行A类份额和银行B类份额即可上市流通；对于托管在场外的份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为银行A类份额和银行B类份额即可上市流通。

8、本基金开通跨系统转托管业务日期：2015年6月18日，具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）基金份额持有情况

截至2015年6月11日的博时银行指数分级基金份额持有情况：

博时银行份额持有人户数为4,394户，平均每户持有的基金份额为33,361.86份；银行A类为810户，平均每户持有的基金份额为86,775.60份；银行B类为810户，平均每户持有的基金份额为86,775.60份。

机构投资者持有的本次上市交易的银行A类与银行B类的基金份额分别为730,050.00份和730,052.00份，分别占本次银行A类与银行B类上市交易基金份额比例1.0387%和1.0387%；个人投资者持有的本次上市交易的银行A类与银行B类的基金份额分别为69,558,188.00份和69,558,186.00份，分别占本次银行A类与银行B类上市交易基金份额比例为98.9613%和98.9613%。

（二）截止2015年6月11日，本次上市交易的银行A类份额和银行B类份额前十名持有人情况：

序号	持有人名称（全称）	持有银行A类份额	占银行A类份额比(%)	持有银行B类份额	占银行B类份额比(%)
1	张秀英	5,000,194	7.11	5,000,194	7.11
2	郑天才	1,000,068	1.42	1,000,068	1.42
3	徐小曼	1,000,019	1.42	1,000,019	1.42
4	贾孝君	929,527	1.32	929,527	1.32
5	吴亚兰	843,524	1.2	843,525	1.2
6	沈慧	800,030	1.14	800,030	1.14
7	方笑	730,014	1.04	730,014	1.04
8	王贝伊	586,011	0.83	586,011	0.83
9	周耀娟	514,014	0.73	514,015	0.73
10	王晓娟	503,009	0.72	503,010	0.72

注：由于四舍五入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

（三）截止到2015年6月11日，基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况

本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为999.69份，占该基金总份额的比例为0.00035%。其中，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量为0份，该只基金的基金经理持有该只基金份额总量为0份。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、名称：博时基金管理有限公司
2、法定代表人：洪小源
3、总裁：王德英（代）
4、注册资本：2.5亿元人民币
5、注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层
6、设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]26号
7、工商登记注册的法人营业执照文号：440301103465194号
8、经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务（涉及行政许可的凭许可证经营）
9、股权结构：目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份49%；中国长城资产管理公司，持有股份25%；瑞安股权投资有限公司，持有股份12%；天津港（集团）有限公司，持有股份6%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份2%。
10、内部组织结构及职能：

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的合法权益。公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设三大总部和十五个直属部门，分别是：权益投资总部、固定收益总部、市场销售总部以及宏观策略部、交易部、指数投资部、特定资产管理部、年金投资部、产品规划部、互联网金融部、董事长办公室、总裁办公室、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、风险管理部和监察法律部。

权益投资总部负责公司所管理资产的权益投资管理及相关工作。权益投资总部下设股票投资部（含各投资风格小组）、研究部。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。研究部负责完成对宏观经济、投资策略、行业上市公司及市场的研究。固定收益总部负责公司所管理资产的固定收益投资管理及相关工作。固定收益总部下设现金管理组、公募基金组、专户组、国际组和研究组，分别负责各类固定收益资产的研究和投资工作。市场销售总部负责公司全国范围内的客户、销售和服务工作。市场销售总部下设机构与零售两大业务线和营销服务部。机构业务线含战略客户部、机构-上海、机构-南方三大区域和养老金部、券商业务部两个部门。战略客户部负责北方地区由国资委和财政部直接管辖企业以及该区域机构客户的销售与服务工作。机构-上海和机构-南方分别主要负责华东地区、华南地区以及其他指定区域的机构客户销售与服务工作。养老金业务部负责养老金业务的研究、拓展和服务等工作。券商业务部负责券商渠道的开拓和销售服务。零售业务线含零售-北京、零售-上海、零售-南方三大区域，以及客户服务中心。其中，零售三大区域负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。客户服务中心负责零售客户的服务和咨询工作。营销服务部负责营销策划、总行渠道维护和销售支持等工作。

宏观策略部负责为投委会审定资产配置计划提供宏观研究和策略研究支持。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。指数投资部负责公司各类指数投资产品的研究和投资管理工作。特定资产管理部负责公司权益类特定资产专户和权益类社保投资组合的投资管理及相关工作。年金投资部负责公司所管理企业年金等养老金资产的投资管理及相关工作。产品规划部负责新产品设计、新产品报批、主管部门沟通维护、产品维护以及年金方案设计等工作。互联网金融部负责公司互联网金融战略规划的设计和实施，公司互联网金融的平台建设、业务拓展和客户运营，推动公司相关业务在互联网平台的整合与创新。董事长办公室专门负责股东会、董事会、监事会及董事会各专委会员会及会员工作；股东关系管理与董、监事的联络、沟通及服务；基金行业政策、公司治理、战略发展研究；与公司治理及发展战略等相关的重大信息披露管理；政府公共关系管理；党务工作；博时慈善基金的管理及运营等。总裁办公室负责公司的战略规划研究、行政后勤支持、会议及文件管理、公司文化建设、品牌传播、对外媒体宣传、外事活动管理、档案管理及工会工作等。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、员工沟通、人力资源信息管理工作。财务部负责公司预算管理、财务核算、成本控制、财务分析等工作。信息技术部负责信息系统开发、网络运行及维护、IT系统安全及数据备份等工作。基金运作部负责基金会计和基金注册登记等业务。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。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察，并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。

另设北京分公司、上海分公司、沈阳分公司、郑州分公司和成都分公司，分别负责对驻京、沪、沈阳、郑州和成都人员日常行政管理和对赴京、沪、沈阳和郑州处理公务人员给予协助。此外，还设有全资子公司博时资本管理有限公司，以及境外子公司博时基金（国际）有限公司。

11、人员情况：

截止到2015年3月30日，公司总人数396人，其中研究员和基金经理超过94%拥有硕士及以上学位。

12、信息披露负责人：孙麒清
电话：0755-83169999
13、本基金基金经理

方维玲女士，双硕士。1978年至1982年在云南大学数学系计算数学专业学习，获理学学士学位。1985年至1988年在云南大学数学系计算数学专业学习，获理学硕士学位。1996年至1999年在财政部科研所财政金融专业学习，获得经济学硕士学位。1982年至1991年在云南大学任教。1991至2000年曾先后在海南省信托投资公司、湘财证券有限责任公司担任证券部经理及营业部总经理。2000年至2001年在北京玖方量子软件技术公司工作。2001年3月加入博时基金管理有限公司，历任金融工程师、数量化投资部副总经理、产品规划部总经理。2010年调任股票投资部ETF及量化投资组，现任博时上证超大盘ETF及其联接基金基金经理（2012年11月13日起至今）、博时自然资源ETF及其联接基金基金经理（2013年9月13日起至今）、博时黄金ETF基金经理（2014年8月13日起至今）、博时中证银行指数分级基金基金经理（2015年6月9日起至今）。

（二）基金托管人
1、基本情况
名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
成立时间：2004年09月17日
注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
法定代表人：王洪章
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号
联系人：田青
客服电话：95566
传真：(010)6759 5096
2、基金托管部门及主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、证券投资基金托管情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2014年9月末，中国建设银行已托管389只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”；获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖；境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖；中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

（三）登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17 号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17 号
法定代表人：周明
联系电话：（010）59378888
传真：（010）59378907
联系人：朱立元
（四）审计基金财产的会计师事务所
名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼
首席合伙人：杨经信
联系电话：（021）23238888
传真电话：（021）23238800
经办注册会计师：薛竞、沈兆杰
联系人：沈兆杰

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用。

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

博时中证银行指数分级证券投资基金，2015年6月11日资产负债表如下：

博时中证银行指数分级证券投资基金

资　产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
资 产：		负债：	
银行存款	287,161,634.70	短期借款	–
结算备付金	–	交易性金融负债	–
存出保证金	–	衍生金融负债	–
交易性金融资产	–	卖出回购金融资产款	–
其中：股票投资	–	应付证券清算款	–
债券投资	–	应付赎回款	–
	–	应付管理人报酬	15,736.13
	–	应付托管费	3,461.95
衍生金融资产	–	应付销售服务费	–
买入返售金融资产	–	应付交易费用	–
应收证券清算款	–	应付税费	–
应收利息	31,407.11	应付利息	–
应收股利	–	应付利润	–
应收申购款	–	其他负债	4,523.42
其他资产	7,034.50	负债合计	23,721.50
		所有者权益：	
		实收基金	287,168,470.70
		未分配利润	7,884.11
		所有者权益合计	287,176,354.81
资产合计：	287,200,076.31	负债与持有人权益总计：	287,200,076.31

（注：报告截止日2015年6月11日，博时中证银行指数分级证券投资基金基金份额总额为287,168,470.70份，其中母基金份额的基金份额净值为1.0000元，基金份额总额为146,591,994.70份；银行A类份额的基金份额参考净值为1.0005元，基金份额总额为70,288,238.00份；银行B类份额的基金份额参考净值为0.9995元，基金份额总额为70,288,238.00份。

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即2015年6月11日，博时中证银行指数分级证券投资基金的投资组合如下：

1、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	–	–
	其中：股票	–	–
2	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	287,161,634.70	99.99%
6	其他各项资产	38,441.61	0.01%
7	合计	287,200,076.31	100.00%

（二）按行业分类的股票投资组合
1、指数投资按行业分类的股票投资组合
注：截至2015年6月11日，本基金未持有指数投资的股票。
2、积极投资按行业分类的股票投资组合
注：截至2015年6月11日，本基金未持有积极投资的股票。
（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细
1、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
注：截至2015年6月11日，本基金未持有指数投资的股票。
2、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
注：截至2015年6月11日，本基金未持有积极投资的股票。
持有积极投资的股票。
（四）按券种分类的债券投资组合
注：截至2015年6月11日，本基金未持有债券。
（五）按公允价值占净值比例大小排序的前五名债券明细
注：截至2015年6月11日，本基金未持有债券。
（六）按公允价值占净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
注：截至2015年6月11日，本基金未持有资产支持证券。
（七）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
截至2015年6月11日，本基金未持有贵金属。
（八）按公允价值占净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注：截至2015年6月11日，本基金未持有权证。
（九）本基金投资的股指期货交易情况说明
注：截至2015年6月11日，本基金未持有股指期货。
（十）本基金投资的国债期货交易情况说明
注：截至2015年6月11日，本基金未持有国债期货。
（十一）投资组合报告附注
1、截至2015年6月11日，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。
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。
3、其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	31,407.11
5	应收申购款	–
6	其他应收款	7,034.50–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	38,441.61

4、截至2015年6月11日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5、截至2015年6月11日，本基金指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明。
注：截至2015年6月11日，本基金未持有指数投资的股票。
6、截至2015年6月11日，本基金积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
截至2015年6月11日，本基金未持有积极投资的股票。
7、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。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

（一）中国证监会核准博时中证银行指数分级证券投资基金募集的文件；
（二）《博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同》；
（三）《博时中证银行指数分级证券投资基金招募说明书》；
（四）《博时中证银行指数分级证券投资基金托管协议》；
（五）法律意见书；
（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；
（七）基金托管人业务资格批件、营业执照；
（八）中国证监会要求的其他文件。

博时基金管理有限公司
2015年6月15日

2015年6月15日

附件：

基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：
（1）依法募集资金；
（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
（4）销售基金份额；
（5）按照规定召集基金份额持有人大会；
（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；
（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构；
（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；
（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：
（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
（2）办理基金备案手续；
（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
（7）依法接受基金托管人的监督；
（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
（10）编制季度、半年度和年度基金报告；
（11）严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
（13）按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；
（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
（18）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
（19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；
（23）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；
（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（26）建立并保存基金份额持有人名册；
（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
（二）　基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：
（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；
（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
（4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；
（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；
（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：
（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
（2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
（4）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
（6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、博时银行A份额和博时银行B份额的基金份额参考净值、博时银行份额申购、赎回价格；
（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
（10）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；
（12）建立并保存基金份额持有人名册；
（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
（14）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定