

博时安荣 18 个月定期开放债券型 证券投资基金更新招募说明书 2016 年第 1 号



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

【重要提示】

1、本基金根据2015年11月2日中国证券监督管理委员会《关于核准博时安荣18个月定期开放债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2015]2440号）。

2、基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

3、投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：利率风险，本基金持有的信用品种违约带来的信用风险，债券回购风险等等；基金运作风险，包括在本基金的封闭运作期间，基金份额持有人面临不能赎回基金份额的风险，以及基金管理人在基金管理运作过程中产生的基金管理风险，等等。此外，本基金以1元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在基金份额净值跌破1元初始面值的风险。本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金，属于中等风险/收益的产品。

4、本基金的一部分资产将可能投资于中小企业私募债券。由于中小企业私募债券发行门槛低，投资过程中的信用风险也相应增加，有可能出现债券到期后，企业不能按时清偿债务，或者在存续期内评级被下调的风险。中小企业私募债券不能在交易所上市交易，而是通过上证所固定收益证券综合电子平台及深交所综合协议交易平台，或证券公司进行转让，同时，交易所按照申报时间先后顺序对私募债券转让进行确认，对导致私募债券投资者超过200人的转让不予确认。因此，本基金在投资中小企业私募债券的过程中，面临着流动性风险。

5、本基金的业绩比较基准为一年期定期存款利率（税后）×150%（每个封闭期首日，1年期定期存款利率根据当日中国人民银行公布并执行的利率水平调整），但本基金的收益水平有可能不能达到或超过同期的目标收益率水平，投资者面临获得低于目标收益率甚至亏损的风险。

6、基金不同于银行储蓄与债券，基金投资者有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及《基金合同》。

7、基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

8、本基金的封闭运作期间，基金份额持有人不能申购、赎回、转换基金份额，因此，若基金份额持有人错过某一开放期而未能赎回，其份额将自动转入下一封闭期，至少到下一开放期方可赎回。

9、基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

10、本招募说明书（跟新）所载内容截止日为**2016年5月24日**，有关财务数据和净值表现截止日为**2016年3月31日**（财务数据未经审计）。

目 录

| | | |
|--------|--------------------|-----|
| 第一部分 | 绪言 | 5 |
| 第二部分 | 释义 | 6 |
| 第三部分 | 基金管理人 | 10 |
| 第四部分 | 基金托管人 | 22 |
| 第五部分 | 相关服务机构 | 27 |
| 第六部分 | 基金的募集与基金合同的生效 | 38 |
| 第七部分 | 基金份额的申购与赎回 | 39 |
| 第八部分 | 基金的投资 | 47 |
| 第九部分 | 基金的业绩 | 54 |
| 第十部分 | 基金的财产 | 55 |
| 第十一部分 | 基金资产的估值 | 56 |
| 第十二部分 | 基金的收益与分配 | 60 |
| 第十三部分 | 基金费用与税收 | 61 |
| 第十四部分 | 基金的会计与审计 | 63 |
| 第十五部分 | 基金的信息披露 | 64 |
| 第十六部分 | 风险揭示 | 69 |
| 第十七部分 | 基金合同的变更、终止与基金财产的清算 | 72 |
| 第十八部分 | 基金合同的内容摘要 | 74 |
| 第十九部分 | 基金托管协议的内容摘要 | 88 |
| 第二十部分 | 对基金份额持有人的服务 | 103 |
| 第二十一部分 | 招募说明书存放及查阅方式 | 105 |
| 第二十二部分 | 其他应披露的事项 | 106 |
| 第二十三部分 | 备查文件 | 108 |

第一部分 绪言

《博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）以及《博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或《基金合同》）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务关系的法律文件。基金投资者依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金
- 2、基金管理人：指博时基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指招商银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
- 16、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
- 17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
- 18、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

20、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

23、销售机构：指博时基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

24、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为博时基金管理有限公司或接受博时基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

28、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

29、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

31、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

32、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

33、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

34、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

36、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

37、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

38、封闭期：指自《基金合同》生效之日起（包括《基金合同》生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）18 个月的期间。本基金的第一个封闭期为自《基金合同》生效之日起至 18 个月后的对应日的期间。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起至 18 个月后的对应日的期间，以此类推。如该对应日不存在对应日期的，则顺延至下一日。

本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易

39、开放期：指自封闭期结束之日后第一个工作日起（含该日）五至二十个工作日，具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务，开放期末赎回的份额将自动转入下一个封闭期。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据《基金合同》暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告

40、开放日：指在开放期内，为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

41、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

42、《业务规则》：指《博时基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

43、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

44、申购：指基金合同生效后的开放期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

45、赎回：指基金合同生效后的开放期内，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

46、基金转换：指基金份额持有人在开放期内按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

47、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

49、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

50、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一工作日基金总份额的 20%

51、元：指人民币元

52、基金收益：指基金投资所得债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

53、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

54、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

55、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

56、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

57、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

58、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

第三部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称： 博时基金管理有限公司

住所： 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

办公地址： 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

法定代表人： 张光华

成立时间： 1998 年 7 月 13 日

注册资本： 2.5 亿元人民币

存续期间： 持续经营

联系人： 韩强

联系电话： (0755) 8316 9999

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准设立。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%；天津港（集团）有限公司，持有股份 6%；上海汇华实业有限公司，持有股份 12%；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%。注册资本为 2.5 亿元人民币。

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。

公司下设两大总部和二十六个直属部门，分别是：权益投资总部、固定收益总部以及宏观策略部、交易部、指数与量化投资部、特定资产管理部、年金投资部、产品规划部、营销服务部、客户服务中心、市场部、养老金业务部、战略客户部、机构-上海、机构-南方、券商业务部、零售-北京、零售-上海、零售-南方、互联网金融部、董事会办公室、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。

市场部负责公司市场和销售管理、销售组织、目标和费用管理、销售督导与营销培训管理、推动金融同业业务合作与拓展、国际业务的推动与协作等工作。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-北京、零售-上海、零售-南方负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。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。指数与量化投资部负责公司各类指数与量化投资产品的研究和投资管理。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。客户服务中心负责零售客户的服务和咨询工作。

董事会办公室专门负责股东会、董事会、监事会及董事会各专业委员会各项会务工作；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；博时慈善基金会的管理及运营等。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、档案管理以及工会工作等。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及绩效分析工作，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。

截止到 2016 年 3 月 31 日，公司总人数为 431 人，其中研究员和基金经理超过 94%拥有硕士及以上学位。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

二、主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

张光华先生，博士，董事长。历任国家外汇管理局政研室副主任，计划处处长，中国人民银行海南省分行副行长、党委委员，中国人民银行广州分行副行长、党委副书记，广东发展银行行长、党委副书记，招商银行副行长、执行董事、副董事长、党委副书记，在招商银行任职期间曾兼任永隆银行副董事长、招商基金管理有限公司董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长、招银国际金融有限公司董事长、招银金融租赁有限公司董事长。2015 年 8 月起，任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人。

熊剑涛先生，硕士，工程师，董事。1992 年 5 月至 1993 年 4 月任职于深圳山星电子有限公司。1993 年起，历任招商银行总行电脑部信息中心副经理，招商证券股份有限公司电脑部副经理、经理、电脑中心总经理、技术总监兼信息技术中心总经理；2004 年 1 月至 2004 年 10 月，被中国证监会借调至南方证券行政接管组任接管组成员；2005 年 12 月起任招商证券股份有限公司副总裁，现分管经纪业务、资产管理业务、信息技术中心，兼任招商期货有限公司董事长、中国证券业协会证券经纪专业委员会副主任委员。2014 年 11 月起，任博时基金管理有限公司第六届董事会董事。

江向阳先生，董事。2015 年 7 月起，任博时基金管理有限公司总经理。中共党员，南开大学国际金融博士，清华大学金融媒体 EMBA。1986-1990 年就读于北京师范大学信息与情报学系，获学士学位；1994-1997 年就读于中国政法大学研究生院，获法学硕士学位；2003-2006 年，就读于南开大学国际经济研究所，获国际金融博士学位。2015 年 1 月至 7 月，任招商局金融集团副总经理、博时基金管理有限公司党委副书记。历任中国证监会办公厅、党办副主任兼新闻办（网信办）主任；中国证监会办公厅副巡视员；中国证监会深圳专员办处长、副专员；中国证监会期货监管部副处长、处长；中国农业工程研究设计院情报室干部。

王金宝先生，硕士，董事。1988 年 7 月至 1995 年 4 月在上海同济大学数学系工作，任教师。1995 年 4 月进入招商证券，先后任上海澳门路营业部总经理、上海地区总部副总经理（主持工作）、投资部总经理、投资部总经理兼固定收益部总经理、股票销售交易部总经理（现更名为机构业务总部）、机构业务董事总经理。2002 年 10 月至 2008 年 7 月，任博时基金管理有限公司第二届、第三届监事会监事。2008 年 7 月起，任博时基金管理有限公司第四届至第六届董事会董事。

陈克庆先生，北京大学工商管理硕士。2001 年起历任世纪证券投资银行北京总部副总经理，国信证券投行业务部副总经理，华西证券投资银行总部副总经理、董事总经理。2014 年加入中国长城资产管理公司，现任投资投行事业部副总经理。

杨林峰先生，硕士，高级经济师，董事。1988 年 8 月就职于国家纺织工业部，1992 年 7 月至 2006 年 6 月任职于中国华源集团有限公司，先后任华源发展股份有限公司（上海证交所上市公司）董秘、副总经理、常务副总经理等职。2006 年 7 月就职于上海市国资委直属上海大盛资产有限公司，任战略投资部副总经理。2007 年 10 月至今，出任上海盛业股权

投资基金有限公司执行董事、总经理。2011 年 7 月至 2013 年 8 月，任博时基金管理有限公司第五届监事会监事。2013 年 8 月起，任博时基金管理有限公司第五届、第六届董事会董事。

顾立基先生，硕士，独立董事。1968 年至 1978 年就职于上海印染机械修配厂，任共青团总支书记；1983 年起，先后任招商局蛇口工业区管理委员会办公室秘书、主任；招商局蛇口工业区免税品有限公司董事总经理；中国国际海运集装箱股份有限公司董事副总经理、总经理；招商局蛇口工业区有限公司副总经理、国际招商局贸易投资有限公司董事副总经理；蛇口招商港务股份有限公司董事总经理；招商局蛇口工业区有限公司董事总经理；香港海通有限公司董事总经理；招商局科技集团有限公司董事总经理、招商局蛇口工业区有限公司副总经理。2008 年退休。2008 年 2 月至今，任清华大学深圳研究生院兼职教授；2008 年 11 月至 2010 年 10 月，兼任招商局科技集团有限公司执行董事；2009 年 6 月至今，兼任中国平安保险（集团）股份有限公司外部监事、监事会主席；2011 年 3 月至今，兼任湘电集团有限公司外部董事；2013 年 5 月至 2014 年 8 月，兼任德华安顾人寿保险有限公司（ECNL）董事；2013 年 6 月至今，兼任深圳市昌红科技股份有限公司独立董事。2014 年 11 月起，任博时基金管理有限公司第六届董事会独立董事。

李南峰先生，学士，独立董事。1969 年起先后在中国人民解放军酒泉卫星基地、四川大学经济系、中国人民银行、深圳国际信托投资公司、华润深国投信托有限公司工作，历任中国人民银行总行金融研究所研究院、深圳特区人行办公室主任，深圳国际信托投资公司副总经理、总经理、董事长、党委书记，华润深国投信托有限公司总经理、副董事长。1994 年至 2008 年曾兼任国信证券股份有限公司董事、董事长。2010 年退休。2013 年 8 月起，任博时基金管理有限公司第五届、第六届董事会独立董事。

何迪先生，硕士，独立董事。1971 年起，先后在北京西城区半导体器件厂、北京东城区电子仪器一厂、中共北京市委党校、社科院美国研究所、加州大学伯克利分校、布鲁津斯学会、标准国际投资管理公司工作。1997 年 9 月至今任瑞银投资银行副主席。2008 年 1 月，何迪先生建立了资助、支持中国经济、社会与国际关系领域中长期问题研究的非营利公益组织“博源基金会”，并担任该基金会总干事。2012 年 7 月起，任博时基金管理有限公司第五届、第六届董事会独立董事。

2、基金管理人监事会成员

车晓昕女士，硕士，监事。1983 年起历任郑州航空工业管理学院助教、讲师、珠海证券有限公司经理、招商证券股份有限公司投资银行总部总经理。现任招商证券股份有限公司财务管理董事总经理。2008 年 7 月起，任博时基金管理有限公司第四至六届监事会监事。

余和研先生，监事。1974 年 12 月入伍服役。自 1979 年 4 月进入中国农业银行总行工作，先后在办公室、农村金融研究所、发展研究部、国际业务部等部门担任科员、副处长、处长等职务；1993 年 8 月起先后在英国和美国担任中国农业银行伦敦代表处首席代表、纽约代表处首席代表；1998 年 8 月回到中国农业银行总行，在零售业务部担任副总经理。1999

年 10 月起在中国长城资产管理公司工作，先后在总部国际业务部、人力资源部担任总经理；2008 年 8 月起先后到中国长城资产管理公司天津办事处、北京办事处担任总经理；2014 年 3 月至今担任中国长城资产管理公司控股的长城国富置业有限公司监事、监事会主席，长城环亚国际投资有限公司董事；2015 年 7 月起任博时基金管理有限公司监事。

赵兴利先生，硕士，监事。1987 年至 1995 年就职于天津港务局计财处。1995 年至 2012 年 5 月先后任天津港贸易公司财务科科长、天津港货运公司会计主管、华夏人寿保险股份有限公司财务部总经理、天津港财务有限公司常务副总经理。2012 年 5 月筹备天津港（集团）有限公司金融事业部，2011 年 11 月至今任天津港（集团）有限公司金融事业部副部长。2013 年 3 月起，任博时基金管理有限公司第五至六届监事会监事。

郑波先生，博士，监事。2001 年起先后在中国平安保险公司总公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司人力资源部总经理。2008 年 7 月起，任博时基金管理有限公司第四至六届监事会监事。

黄健斌先生，工商管理硕士。1995 年起先后在广发证券有限公司、广发基金管理有限责任公司投资管理部、中银国际基金管理有限公司基金管理部工作。2005 年加入博时基金管理公司，历任固定收益部基金经理、博时平衡配置混合型证券投资基金基金经理、固定收益部副总经理、社保组合投资经理、固定收益部总经理。现任公司总经理助理兼固定收益总部董事总经理、年金投资部总经理、社保组合投资经理、高级投资经理、兼任博时资本管理有限公司董事。2016 年 3 月 18 日至今担任博时基金管理有限公司监事会员工监事。

严斌先生，硕士，监事。1997 年 7 月起先后在华侨城集团公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司财务部副总经理。2015 年 5 月起，任博时基金管理有限公司第六届监事会监事。

3、高级管理人员

张光华先生，简历同上。

江向阳先生，简历同上。

王德英先生，硕士，副总经理。1995 年起先后在北京清华计算机公司任开发部经理、清华紫光股份公司 CAD 与信息事业部任总工程师。2000 年加入博时基金管理有限公司，历任行政管理部副经理，电脑部副经理、信息技术部总经理、公司代总经理。现任公司副总经理，主管 IT、财务、运作、指数与量化投资和互联网金融等工作，博时基金（国际）有限公司及博时资本管理有限公司董事。

董良泓先生，CFA，MBA，副总经理。1993 年起先后在中国技术进出口总公司、中技上海投资公司、融通基金管理有限公司、长城基金管理有限公司从事投资管理工作。2005 年 2 月加入博时基金管理有限公司，历任社保股票基金经理，特定资产高级投资经理，研究部总经理兼特定资产高级投资经理、社保股票基金经理、特定资产管理部总经理。现任公司副总

经理兼高级投资经理、社保组合投资经理，兼任博时基金（国际）有限公司董事、博时资本管理有限公司董事。

邵凯先生，经济学硕士，副总经理。1997 年至 1999 年在河北省经济开发投资公司从事投资管理的工作。2000 年 8 月加入博时基金管理有限公司，历任债券组合经理助理、债券组合经理、社保债券基金基金经理、固定收益部副总经理兼社保债券基金基金经理、固定收益部总经理、固定收益投资总监、社保组合投资经理。现任公司副总经理、兼任博时基金（国际）有限公司董事、博时资本管理有限公司董事。

徐卫先生，硕士，副总经理。1993 年起先后在深圳市证券管理办公室、中国证监会、摩根士丹利华鑫基金工作。2015 年 6 月加入博时基金管理有限公司，现任公司副总经理。

孙麒清女士，商法学硕士，督察长。曾供职于广东深港律师事务所。2002 年加入博时基金管理有限公司，历任监察法律部法律顾问、监察法律部总经理。现任公司督察长，兼任博时基金（国际）有限公司董事、博时资本管理有限公司副董事长。

4、本基金基金经理

魏桢女士，学士。2004 年起在厦门市商业银行任债券交易组主管。2008 年加入博时基金管理有限公司，历任债券交易员、固定收益研究员、博时理财 30 天债券基金（2013-01-28 至 2015-09-10）、博时岁岁增利一年定期开放债券基金（2013-06-26 至 2016-04-25）、博时月月薪定期支付债券基金（2013-7-25 至 2016-04-25）、博时双月薪定期支付债券基金的基金经理（2013-7-25 至 2016-04-25）。现任固定收益总部现金管理组投资副总监兼博时安丰 18 个月定期开放债券（LOF）基金（2013-08-22 至今）、博时天天增利货币市场基金（2014-08-25 至今）、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金（2014-09-02 至今）、博时现金宝货币市场基金（2014-09-18 至今）、博时现金收益货币基金（2015-05-22 至今）、博时安盈债券基金（2015-05-22 至今）、博时保证金货币 ETF 基金（2015-06-08 至今）、博时外服货币基金（2015-06-19 至今）、博时安荣 18 个月定期开放债券基金（2015-11-24 至今）、博时裕创纯债债券型证券投资基金（2016-05-13 至今）、博时安润 18 个月定开债基金（2016-05-20 至今）、博时裕盛纯债债券基金（2016-05-20 至今）、博时产业债纯债基金（2016-05-25 至今）的基金经理。

5、投资决策委员会成员

委员：江向阳、邵凯、黄健斌、李权胜、欧阳凡、魏凤春、王俊

江向阳先生，简历同上。

邵凯先生，简历同上。

黄健斌先生，简历同上。

李权胜先生，硕士。2001 年起先后在招商证券、银华基金工作。2006 年加入博时基金管理有限公司，历任研究员、研究员兼基金经理助理、特定资产投资经理、特定资产管理部副总经理、博时医疗保健行业股票基金基金经理、股票投资部副总经理、股票投资部成长组投资总监。现任股票投资部总经理兼价值组投资总监、博时精选股票基金基金经理。

欧阳凡先生，硕士。2003 年起先后在衡阳市金杯电缆厂、南方基金工作。2011 年加入博时基金管理有限公司，曾任特定资产管理部副总经理、社保组合投资经理助理。现任特定资产管理部总经理兼社保组合投资经理。

魏凤春先生，经济学博士。1993 年起先后在山东经济学院、江南证券、清华大学、江南证券、中信建投证券公司工作。2011 年加入博时基金管理有限公司，曾任投资经理。现任宏观策略部总经理兼博时抗通胀增强回报（QDII-FOF）基金、博时平衡配置混合基金的基金经理。

王俊先生，硕士，CFA。2008 年从上海交通大学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、金融地产与公用事业组组长、研究部副总经理。现任研究部总经理兼博时主题行业混合（LOF）基金、博时国企改革股票基金、博时丝路主题股票基金的基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

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前提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。

四、基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- (1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 侵占、挪用基金财产；
- (6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生；

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责；

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

五、基金经理承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益；

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内

容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

六、基金管理人的内部控制制度

1、风险管理的原则

(1) 全面性原则

公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节。

(2) 独立性原则

公司设立独立的监察部，监察部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查。

(3) 相互制约原则

公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

(4) 定性和定量相结合原则

建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对风险管理负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

(1) 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。

(2) 风险管理委员会

作为董事会下的专业委员会之一，风险管理委员会负责批准公司风险管理系统文件，即负责确保每一个部门都有合适的系统来识别、评定和监控该部门的风险，负责批准每一个部门的风险级别。负责解决重大的突发的风险。

(3) 督察长

独立行使督察权利；直接对董事会负责；按季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。

(4) 监察法律部

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。

(5) 风险管理部

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。

(6) 业务部门

风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任,负责
履行公司的风险管理程序,负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护,用于识别、监
控和降低风险。

3、风险管理和内部风险控制的措施

(1) 建立内控结构,完善内控制度

公司建立、健全了内控结构,高管人员关于内控有明确的分工,确保各项业务活动有恰
当的组织和授权,确保监察活动是独立的,并得到高管人员的支持,同时置备操作手册,并
定期更新。

(2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制

建立、健全了各项制度,做到基金经理分开,投资决策分开,基金交易集中,形成不同
部门,不同岗位之间的制衡机制,从制度上减少和防范风险。

(3) 建立、健全岗位责任制

建立、健全了岗位责任制,使每个员工都明确自己的任务、职责,并及时将各自工作领
域中的风险隐患上报,以防范和减少风险。

(4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序

建立了评估风险的委员会,使用适合的程序,确认和评估与公司运作有关的风险;公司
建立了自下而上的风险报告程序,对风险隐患进行层层汇报,使各个层次的人员及时掌握风
险状况,从而以最快速度作出决策。

(5) 建立有效的内部监控系统

建立了足够、有效的内部监控系统,如电脑预警系统、投资监控系统,对可能出现的各
种风险进行全面和实时的监控。

(6) 使用数量化的风险管理手段

采取数量化、技术化的风险控制手段,建立数量化的风险管理模型,用以提示指数趋势、
行业及个股的风险,以便公司及时采取有效的措施,对风险进行分散、控制和规避,尽可能
地减少损失。

(7) 提供足够的培训

制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

第四部分 基金托管人

一、基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于 2002 年 3 月成功地发行了 15 亿 A 股，4 月 9 日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股，9 月 22 日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10 月 5 日行使 H 股超额配售，共发行了 24.2 亿 H 股。截止，2015 年 12 月 31 日，本集团总资产 5.475 万亿元人民币，高级法下资本充足率 12.57%，权重法下资本充足率 11.91%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室 5 个职能处室，现有员工 60 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，

成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

经过十四年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2016 年招商银行加大高收益托管产品营销力度，截止 3 月末新增托管公募开放式基金 12 只，新增首发公募开放式基金托管规模 114.94 亿元。克服国内证券市场震荡的不利形势，托管费收入、托管资产均创出历史新高，实现托管费收入 11.835 亿元，同比增长 6.789%，托管资产余额 7.596 万亿元，同比增长 104.08%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人，成功签约“壹基金”公益资金托管，为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索，该项目荣获 2012 中国金融品牌「金象奖」“十大公益项目”奖；四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。

二、主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014 年 7 月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013 年 5 月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

丁伟先生，本行副行长。大学本科毕业，副研究员。1996 年 12 月加入本行，历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理，杭州分行行长助理、副行长，南昌支行行长，南昌分行行长，总行人力资源部总经理，总行行长助理，2008 年 4 月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002 年 9 月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有 20 余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

三、基金托管业务经营情况

截至 2016 年 3 月 31 日,招商银行股份有限公司累计托管 163 只开放式基金及其它托管资产,托管资产为 7.596 万亿元人民币。

四、托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念;形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制,防范和化解经营风险,确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整;建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患,保证业务稳健运行的风险控制制度,确保托管业务信息真实、准确、完整、及时;确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系:

一级风险防范是在总行层面对风险进行预防和控制。

二级防范是总行资产托管部设立稽核监察室,负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下,独立于部门内其他业务室和托管分部、分行资产托管业务主管部门,对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督,及时发现内部控制缺陷,提出整改方案,跟踪整改情况。

三级风险防范是总行资产托管部在专业岗位设置时,必须遵循内控制衡原则,监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

3、内部控制原则

(1) 全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位,并由全部人员参与。

(2) 审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险,托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点,应当体现“内控优先”的要求。

(3) 独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立,不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门,稽核监察室应保持高度的独立性和权威性,负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

(4) 有效性原则。内部控制应当具有高度的权威性,任何人不得拥有不受内部控制约束的权利,内部控制存在的问题应当能够得到及时的反馈和纠正。

(5) 适应性原则。内部控制应适应我行托管业务风险管理的需要,并能随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。内部控制应随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修订和完善。

(6) 防火墙原则。业务营运、稽核监察等相关室，应当在制度和人员上适当分离，办公网和业务网分离，部门业务网和全行业务网分离，以达到风险防范的目的。

(7) 重要性原则。内部控制应当在全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险领域。

(8) 制衡性原则。内部控制应当在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

(9) 成本效益原则。内部控制应当权衡托管业务的实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

4、内部控制措施

(1) 完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行资产托管业务内控管理办法》、《招商银行基金托管业务操作规程》和等一系列规章制度，从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作，切实维护托管业务各当事人的利益，避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理，招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》，并建立了灾难备份中心，各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份，确保灾难发生时，托管业务能迅速恢复和不间断运行。

(2) 经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险。

(3) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部采用加密方式传输数据。数据执行异地同步灾备，同时，每日实时对托管业务数据库进行备份，托管业务数据每日进行备份，所有的业务信息须经过严格的授权才能进行访问。

(4) 客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

(5) 信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房 24 小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护等，保证信息技术系统的安全。

(6) 人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯队队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源控制。

五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、

基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人义务配合和协助基金托管人依照法律法规基金合同和托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应及时报告中国证监会，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。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、直销机构

(1) 博时基金管理有限公司北京分公司及北京直销中心

名称：博时基金管理有限公司北京分公司及北京直销中心
地址：北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层
电话：010-65187055
传真：010-65187032、010-65187592
联系人：尚继源
博时一线通：95105568（免长途话费）

(2) 博时基金管理有限公司上海分公司

名称：博时基金管理有限公司上海分公司
地址：上海市黄浦区中山南路 28 号久事大厦 25 层
电话：021-33024909
传真：021-63305180
联系人：周明远

(3) 博时基金管理有限公司总公司

名称：博时基金管理有限公司总公司
地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层
电话：0755-83169999
传真：0755-83199450
联系人：程姣姣

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

基金销售机构的具体名单见基金份额发售公告，基金管理人可依据实际情况增减、变更基金销售机构。

2 代销机构

(1) 中国银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |
| 办公地址: | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |
| 法定代表人: | 田国立 |
| 联系人: | 高越 |
| 电话: | 010-66594973 |
| 客户服务电话: | 95566 |
| 网址: | http://www.boc.cn/ |

(2) 交通银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 上海市银城中路 188 号 |
| 办公地址: | 上海市银城中路 188 号 |
| 法定代表人: | 牛锡明 |
| 联系人: | 张宏革 |
| 电话: | 021-58781234 |
| 传真: | 021-58408483 |
| 客户服务电话: | 95559 |
| 网址: | http://www.bankcomm.com/ |

(3) 招商银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 深圳市福田区深南大道 7088 号 |
| 办公地址: | 深圳市福田区深南大道 7088 号 |
| 法定代表人: | 李建红 |
| 联系人: | 邓炯鹏 |
| 电话: | 0755-83198888 |
| 传真: | 0755-83195049 |
| 客户服务电话: | 95555 |
| 网址: | http://www.cmbchina.com/ |

(4) 上海浦东发展银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 上海市中山东一路 12 号 |
| 办公地址: | 上海市北京东路 689 号东银大厦 25 楼 |
| 法定代表人: | 吉晓辉 |
| 联系人: | 吴斌 |
| 电话: | 021-61618888 |
| 传真: | 021-63602431 |
| 客户服务电话: | 95528 |
| 网址: | http://www.spdb.com.cn |

(5) 平安银行股份有限公司

| | |
|---------|----------------|
| 注册地址: | 深圳市深南东路 5047 号 |
| 办公地址: | 深圳市深南东路 5047 号 |
| 法定代表人: | 孙建一 |
| 联系人: | 张莉 |
| 电话: | 021-38637673 |
| 传真: | 021-50979507 |
| 客户服务电话: | 95511-3 |

| | |
|-----|---|
| 网址: | http://bank.pingan.com |
|-----|---|

(6) 东莞银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 东莞市莞城区体育路 21 号 |
| 办公地址: | 东莞市莞城区体育路 21 号 |
| 法定代表人: | 廖玉林 |
| 联系人: | 巫渝峰 |
| 电话: | 0769-22119061 |
| 传真: | 0769-22117730 |
| 客户服务电话: | 4001196228;0769-96228 |
| 网址: | http://www.dongguanbank.cn |

(7) 深圳农村商业银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦 |
| 办公地址: | 广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦 |
| 法定代表人: | 李伟 |
| 联系人: | 宋永成 |
| 电话: | 0755-25188266 |
| 传真: | 0755-25188785 |
| 客户服务电话: | 961200, 4001961200 |
| 网址: | http://www.4001961200.com |

(8) 哈尔滨银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 哈尔滨市道里区尚志大街 160 号 |
| 办公地址: | 哈尔滨市道里区尚志大街 160 号 |
| 法定代表人: | 郭志文 |
| 联系人: | 遇玺 |
| 电话: | 0451-86779018 |
| 传真: | 0451-86779018 |
| 客户服务电话: | 95537 |
| 网址: | http://www.hrbb.com.cn |

(9) 重庆银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 重庆市渝中区邹容路 153 号 |
| 办公地址: | 重庆市渝中区邹容路 153 号 |
| 法定代表人: | 甘为民 |
| 联系人: | 孔文超 |
| 电话: | 023- 63792212 |
| 传真: | 023- 63792412 |
| 客户服务电话: | 96899 (重庆)、400-70-96899 (其他地区) |
| 网址: | http://www.cqcbank.com |

(10) 东莞农村商业银行股份有限公司

| | |
|--------|---------------------------|
| 注册地址: | 广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号 |
| 办公地址: | 广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦 |
| 法定代表人: | 何沛良 |
| 联系人: | 杨亢 |

| | |
|---------|---|
| 电话: | 0769-22866270 |
| 传真: | 0769-22320896 |
| 客户服务电话: | 961122 |
| 网址: | http://www.drcbank.com/ |

(11) 河北银行股份有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 河北省石家庄市平安北大街 28 号 |
| 办公地址: | 河北省石家庄市平安北大街 28 号 |
| 法定代表人: | 乔志强 |
| 联系人: | 王娟 |
| 电话: | 0311-88627587 |
| 传真: | 0311-88627027 |
| 客户服务电话: | 400-612-9999 |
| 网址: | http://www.hebbank.com |

(12) 重庆农村商业银行股份有限公司

| | |
|---------|--|
| 注册地址: | 重庆市江北区洋河东路 10 号 |
| 办公地址: | 重庆市江北区洋河东路 10 号 |
| 法定代表人: | 刘建忠 |
| 联系人: | 范亮 |
| 电话: | 023-67637962 |
| 客户服务电话: | 966866 |
| 网址: | www.cqrcb.com |

(13) 江苏吴江农村商业银行股份有限公司

| | |
|---------|--|
| 注册地址: | 江苏省苏州市吴江区中山南路 1777 号 |
| 办公地址: | 江苏省苏州市吴江区中山南路 1777 号 |
| 法定代表人: | 陆玉根 |
| 联系人: | 傅巍群 |
| 电话: | 0512-63969900 |
| 传真: | 0512-63969071 |
| 客户服务电话: | 4008696068 0512-96068 |
| 网址: | www.wjrcb.com |

(14) 苏州银行股份有限公司

| | |
|---------|--|
| 注册地址: | 江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号 |
| 办公地址: | 江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号 |
| 法定代表人: | 王兰凤 |
| 联系人: | 熊志强 |
| 电话: | 0512-69868390 |
| 传真: | 0512-69868370 |
| 客户服务电话: | 96067 |
| 网址: | www.suzhoubank.com |

(15) 晋商银行股份有限公司

| | |
|-------|----------------------|
| 注册地址: | 山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦 |
| 办公地址: | 山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦 |

| | |
|---------|---|
| 法定代表人: | 上官永清 |
| 联系人: | 董嘉文 |
| 电话: | 0351-6819579 |
| 传真: | 0351-6819926 |
| 客户服务电话: | 9510-5588 |
| 网址: | http://www.jshbank.com |

(16) 福建海峡银行股份有限公司

| | |
|---------|--|
| 注册地址: | 福州市六一北路 158 号 |
| 办公地址: | 福州市六一北路 158 号 |
| 法定代表人: | 苏素华 |
| 联系人: | 张智慧、陈屹、张翠娟 |
| 电话: | 0591-87327302 |
| 传真: | 0591-87330926 |
| 客户服务电话: | 400-893-9999 |
| 网址: | www.fjhxbank.com |

(17) 和讯信息科技有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层 |
| 办公地址: | 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层 |
| 法定代表人: | 王莉 |
| 联系人: | 张紫薇 |
| 电话: | 0755-82721122-8625 |
| 传真: | 0755-82029055 |
| 客户服务电话: | 400-920-0022 |
| 网址: | http://Licaike.hexun.com |

(18) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室 |
| 办公地址: | 上海浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室 |
| 法定代表人: | 汪静波 |
| 联系人: | 方成 |
| 电话: | 021-38602377 |
| 传真: | 021-38509777 |
| 客户服务电话: | 400-821-5399 |
| 网址: | http://www.noah-fund.com |

(19) 深圳众禄金融控股股份有限公司

| | |
|---------|--|
| 注册地址: | 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 |
| 办公地址: | 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 |
| 法定代表人: | 薛峰 |
| 联系人: | 童彩平 |
| 电话: | 0755-33227950 |
| 传真: | 0755-33227951 |
| 客户服务电话: | 400-678-8887 |
| 网址: | https://www.zlfund.cn/ ; www.jjmmw.com |

(20) 上海天天基金销售有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层 |
| 办公地址: | 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼 |
| 法定代表人: | 其实 |
| 联系人: | 潘世友 |
| 电话: | 021-54509998 |
| 传真: | 021-64385308 |
| 客户服务电话: | 400-1818-188 |
| 网址: | http://www.1234567.com.cn |

(21) 上海好买基金销售有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室 |
| 办公地址: | 上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室 |
| 法定代表人: | 杨文斌 |
| 联系人: | 张茹 |
| 电话: | 021-20613610 |
| 客户服务电话: | 400-700-9665 |
| 网址: | http://www.ehowbuy.com |

(22) 杭州数米基金销售有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室 |
| 办公地址: | 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼 |
| 法定代表人: | 陈柏青 |
| 联系人: | 朱晓超 |
| 电话: | 021-60897840 |
| 传真: | 0571-26697013 |
| 客户服务电话: | 400-076-6123 |
| 网址: | http://www.fund123.cn |

(23) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室 |
| 办公地址: | 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层 |
| 法定代表人: | 张跃伟 |
| 联系人: | 敖玲 |
| 电话: | 021-58788678-8201 |
| 传真: | 021-58787698 |
| 客户服务电话: | 400-820-2899 |
| 网址: | http://www.erichfund.com |

(24) 浙江同花顺基金销售有限公司

| | |
|---------|----------------------------|
| 注册地址: | 杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室 |
| 办公地址: | 浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼 |
| 法定代表人: | 凌顺平 |
| 联系人: | 吴杰 |
| 电话: | 0571-88911818 |
| 传真: | 0571-86800423 |
| 客户服务电话: | 0571-88920897、4008-773-772 |

| | |
|-----|---|
| 网址: | http://www.5ifund.com |
|-----|---|

(25) 嘉实财富管理有限公司

| | |
|---------|--|
| 注册地址: | 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元 |
| 办公地址: | 北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层 |
| 法定代表人: | 赵学军 |
| 联系人: | 余永健 |
| 电话: | 010-85097570 |
| 传真: | 010-65215433 |
| 客户服务电话: | 400-021-8850 |
| 网址: | www.harvestwm.cn |

(26) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809 |
| 办公地址: | 北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 18 层 1809 |
| 法定代表人: | 沈伟桦 |
| 联系人: | 程刚 |
| 电话: | 010-52855713 |
| 传真: | 010-85894285 |
| 客户服务电话: | 400-609-9200 |
| 网址: | http://www.yixinfund.com |

(27) 深圳腾元基金销售有限公司

| | |
|---------|--|
| 注册地址: | 深圳市福田区金田路 2028 号卓越世纪中心 1 号楼 1806-1808 |
| 办公地址: | 深圳市福田区金田路 2028 号卓越世纪中心 1 号楼 1806-1808 |
| 法定代表人: | 曾革 |
| 联系人: | 鄢萌莎 |
| 电话: | 0755-33376922 |
| 传真: | 0755-33065516 |
| 客户服务电话: | 400-990-8600 |
| 网址: | www.tenyuanfund.com |

(28) 北京恒天明泽基金销售有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号 5 层 5122 室 |
| 办公地址: | 北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层 |
| 法定代表人: | 周斌 |
| 联系人: | 马鹏程 |
| 电话: | 010-57756074 |
| 传真: | 010-56810782 |
| 客户服务电话: | 400-898-0618 |
| 网址: | http://www.chtfund.com |

(29) 一路财富(北京)信息科技有限公司

| | |
|--------|--------------------------------|
| 注册地址: | 北京市西城区车公庄大街 9 号院 5 号楼 702 |
| 办公地址: | 北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界 A 座 2208 |
| 法定代表人: | 吴雪秀 |
| 联系人: | 段京璐 |

| | |
|---------|---|
| 电话: | 010-88312877 |
| 传真: | 010-88312099 |
| 客户服务电话: | 400-001-1566 |
| 网址: | http://www.yilucaifu.com |

(30)北京钱景财富投资管理有限公司

| | |
|---------|--|
| 注册地址: | 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012 |
| 办公地址: | 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012 |
| 法定代表人: | 赵荣春 |
| 联系人: | 魏争 |
| 电话: | 010-57418829 |
| 传真: | 010-57569671 |
| 客户服务电话: | 400-893-6885 |
| 网址: | www.qianjing.com |

(31)海银基金销售有限公司

| | |
|---------|--|
| 注册地址: | 上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元 |
| 办公地址: | 上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元 |
| 法定代表人: | 刘惠 |
| 联系人: | 毛林 |
| 电话: | 021-80133597 |
| 传真: | 021-80133413 |
| 客户服务电话: | 400-808-1016 |
| 网址: | www.fundhaiyin.com |

(32)北京坤元投资咨询有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 871 室 |
| 办公地址: | 北京市东城区建国门内大街 8 号 B 座 501 |
| 法定代表人: | 李雪松 |
| 联系人: | 马镜 |
| 电话: | 010-85264505 |
| 传真: | 010-85264522 |
| 客户服务电话: | 010-85264528 |
| 网址: | http://www.kunyuanfund.com |

(33)北京微动利投资管理有限公司

| | |
|---------|--|
| 注册地址: | 北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341 |
| 办公地址: | 北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341 |
| 法定代表人: | 梁洪军 |
| 联系人: | 季长军 |
| 电话: | 010-68854005 |
| 传真: | 010-68854009 |
| 客户服务电话: | 400-8196-665 |
| 网址: | www.buyforyou.com.cn |

(34)深圳富济财富管理有限公司

| | |
|-------|------------------------------|
| 注册地址: | 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室 |
|-------|------------------------------|

| | |
|---------|-------------------------|
| 办公地址: | 深圳市南山区高新南七道惠恒集团二期 418 室 |
| 法定代表人: | 齐小贺 |
| 联系人: | 陈勇军 |
| 电话: | 0755-83999907 |
| 传真: | 0755-83999926 |
| 客户服务电话: | 0755-83999913 |
| 网址: | www.jinqianwo.cn |

(35) 上海陆金所资产管理有限公司

| | |
|---------|--------------------------------|
| 注册地址: | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元 |
| 办公地址: | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 |
| 法定代表人: | 郭坚 |
| 联系人: | 宁博宇 |
| 电话: | 021-20665952 |
| 传真: | 021-22066653 |
| 客户服务电话: | 400-821-9031 |
| 网址: | www.lufunds.com |

(36) 珠海盈米财富管理有限公司

| | |
|---------|---|
| 注册地址: | 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491 |
| 办公地址: | 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203 |
| 法定代表人: | 肖雯 |
| 联系人: | 吴煜浩 |
| 电话: | 020-89629099 |
| 传真: | 020-89629011 |
| 客户服务电话: | 020-80629066 |
| 网址: | www.yingmi.cn |

(37) 北京懒猫金融信息服务有限公司

| | |
|---------|-----------------------------------|
| 注册地址: | 北京市石景山区石景山路 31 号院盛景国际广场 3 号楼 1119 |
| 办公地址: | 北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区 1111 号 6 层 |
| 法定代表人: | 许贤良 |
| 联系人: | 肖金凤 |
| 电话: | 01056050791 |
| 客户服务电话: | 4001500882 |
| 网址: | www.lanmao.com |

(38) 北京蕙次方资产管理有限公司

| | |
|---------|--|
| 注册地址: | 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507 |
| 办公地址: | 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507 |
| 法定代表人: | 钟斐斐 |
| 联系人: | 戚晓强 |
| 电话: | 15810005516 |
| 传真: | 010-85659484 |
| 客户服务电话: | 400-061-8518 |
| 网址: | http://www.ncfjj.com |

(39) 泉州银行股份有限公司

| | |
|---------|---------------|
| 注册地址: | 泉州市丰泽区云鹿路 3 号 |
| 办公地址: | 泉州市丰泽区云鹿路 3 号 |
| 法定代表人: | 傅子能 |
| 联系人: | 董培姗 |
| 电话: | 0595-22551071 |
| 传真: | 0595-22505215 |
| 客户服务电话: | 400-889-6312 |
| 网址: | www.qzccb.com |

(40) 德州银行股份有限公司

| | |
|---------|-------------------|
| 注册地址: | 山东省德州市三八东路 1266 号 |
| 办公地址: | 山东省德州市三八东路 1266 号 |
| 法定代表人: | 孙玉芝 |
| 联系人: | 王方震 |
| 电话: | 0534-2297326 |
| 传真: | 0534-2297327 |
| 客户服务电话: | 40084-96588 |
| 网址: | www.dzbchina.com |

二、登记机构

名称: 博时基金管理有限公司
住所: 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层
办公地址: 北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层
法定代表人: 张光华
电话: 010-65171166
传真: 010-65187068
联系人: 许鹏

三、出具法律意见书的律师事务所

名称: 上海市通力律师事务所
注册地址: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
办公地址: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
负责人: 俞卫锋
电话: 021- 31358666
传真: 021- 31358600
联系人: 安冬
经办律师: 安冬、陆奇

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

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真电话：（021）23238800

联系人：陈熹

经办注册会计师：薛竞、陈熹

第六部分 基金的募集与基金合同的生效

一、基金的募集

基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集本基金，并于2015年11月2日获中国证监会《关于准予博时安荣18个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]2440号）注册。

本基金募集期从2015年11月16日至2015年11月20日止，基金份额共募集2,311,274,808.79份（含利息结转的份额），有效认购户数为4553户。

本基金运作方式为契约型开放式，存续期间为不定期。

一、基金合同的生效

本基金的基金合同已于2015年11月24日正式生效。

二、基金存续期内基金份额持有人数量和资产规模

本基金在基金合同生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

第七部分 基金份额的申购与赎回

一、开放期和封闭期

自基金合同生效日起（包括基金合同生效日）或者每一个开放期结束之日次日起（包括该日）18 个月的期间内，本基金采取封闭运作模式，基金份额持有人不得申请申购、赎回本基金。本基金的第一个封闭期为自《基金合同》生效之日起至 18 个月后的对应日的期间。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起至 18 个月后的对应日的期间，以此类推。如该对应日不存在对应日期的，则顺延至下一日。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

每一个封闭期结束后，本基金即进入开放期，开放期的期限为自封闭期结束之日后第一个工作日起（含该日）五至二十个工作日，具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。开放期末赎回的份额将自动转入下一个封闭期。

如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据《基金合同》暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。

二、申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的其他销售机构。

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

三、申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金开放期内，投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。在封闭期内，本基金不办理申购、赎回业务，也不上市交易。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金每个封闭期结束之后第一个工作日起进入开放期，开放期的期限为自封闭期结束之日后第一个工作日起（含该日）五至二十个工作日，具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。

如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据《基金合

同》暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。

在开放期内，投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为该开放期下一开放日基金份额申购、赎回的价格；但若投资人在开放期最后一日业务办理时间结束之后提出申购、赎回或者转换申请的，视为无效申请。开放期以及开放期办理申购与赎回业务的具体事宜见基金管理人届时发布的相关公告。

四、申购与赎回的数额限制

1、投资人首次购买基金份额的最低金额为 1 元，追加购买最低金额为 1 元；详情请见当地销售机构公告；

2、每个交易账户最低持有基金份额余额为 1 份；

3、本基金目前对单个投资人累计持有份额不设上限限制，基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额数量限制，具体规定见定期更新的招募说明书或相关公告；

4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定进行公告并报中国证监会备案。

四、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

五、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放期的开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须在规定时间前全额交付申购款项，投资人在规定时

间前全额交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同约定的延缓支付赎回款项时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

六、申购费率、赎回费率

1、本基金在申购时收取申购费用，并对通过直销中心申购本基金的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

(1) 对于通过基金管理人的直销中心申购本基金的养老金客户，本基金申购费率最高不高于 0.06%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示：

| 购买金额 (M) | 申购费率 |
|-------------------|----------|
| M < 50 万 | 0.06% |
| 50 万 ≤ M < 300 万 | 0.03% |
| 300 万 ≤ M < 500 万 | 0.008% |
| M ≥ 500 万 | 每笔 100 元 |

养老金客户指基本养老保险基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。

(2) 除上述养老金客户外，本基金的投资者，本基金申购费率最高不高于 0.6%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示：

| 购买金额 (M) | 申购费率 |
|-----------|-------|
| M < 50 万元 | 0.60% |

| | |
|-----------------|----------|
| 50 万元≤M<300 万元 | 0.30% |
| 300 万元≤M<500 万元 | 0.08% |
| M≥500 万元 | 1000 元/笔 |

2、本基金不收取赎回费用。

3、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率或收费方式。费率或收费方式如发生变更，基金管理人应在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

七、申购份额与赎回金额的计算方式

1、本基金申购份额的计算方式

申购费用适用比例费率时：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

申购费用适用固定金额时：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

申购份额的计算结果均按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例1：假定T日基金份额净值为1.016元，某投资人（非养老金客户）本次通过申购本基金10万元，对应的本次申购费率为0.60%，该投资人可得到的基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 0.6\%) = 99,403.58 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 99,403.58 = 596.42 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 99,403.58 / 1.016 = 97,838.17 \text{ 份}$$

即：投资者（非养老金客户）投资10万元申购本基金，假定申购当日基金份额净值为1.016元，可得到97,838.17份基金份额。

2、赎回金额的计算方式：

本基金赎回金额的计算公式为：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{T日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = 0$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - 0$$

赎回金额计算结果均按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：某投资者赎回本基金10万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.017

元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 100,000 \times 1.017 = 101,700.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 0 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 101,700.00 - 0 = 101,700.00 \text{ 元}$$

即：投资者赎回本基金 10 万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.017 元，则其可得到的赎回金额为 101,700.00 元。

3、基金份额净值的计算

本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率并进行公告。

八、申购与赎回的登记

1、经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资者申购基金成功后，登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

3、投资者赎回基金成功后，登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

4、基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

九、拒绝或暂停申购的情形及处理

在开放期间，发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、6项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理，且开放期间可以按暂停申购的期间相应延长。

十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

在开放期间，发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请。

5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，基金管理人可对赎回款项进行延缓支付。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告，且开放期间可以按暂停赎回的期间相应延长。

十一、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的基金总份额的20%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

本基金出现巨额赎回的，基金管理人符合法律法规及基金合同约定的赎回申请

应于当日全部予以办理和确认。但对于已接受的赎回申请，如基金管理人认为全额支付投资人的赎回款项有困难或认为全额支付投资人的赎回款项可能会对基金的资产净值造成较大波动的，基金管理人可对赎回款项进行延缓支付，但不得超过20个工作日。延缓支付的赎回申请以赎回申请当日的基金份额净值为基础计算赎回金额。如基金管理人无法在20个工作日内支付上述未支付部分的赎回款项，或基金管理人认为在变现过程中由于存在明显损害其他基金份额持有人利益的情形，基金管理人可不经基金份额持有人大会决议，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后，终止《基金合同》。

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延缓支付赎回款项时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内于指定媒介上刊登暂停公告。

2、上述暂停申购或赎回情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近1个工作日的基金份额净值。

3、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

十三、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

十四、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

十五、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

十六、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

十七、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

十八、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

第八部分 基金的投资

一、投资目标

在谨慎投资的前提下，本基金力争战胜业绩比较基准，追求基金资产的长期、稳健、持续增值。

二、投资范围

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国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、中小企业私募债券、短期融资券及超级短期融资券、可分离交易债券的纯债、资产支持证券、回购和银行定期存款等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类证券（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，在封闭期内，本基金不受上述5%的限制。

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。

三、投资策略

1、封闭期投资策略

（1）资产配置策略

本基金为债券型基金，基金的投资范围为：国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、中小企业私募债券、短期融资券及超级短期融资券、可分离交易债券的纯债、资产支持证券、回购和银行定期存款等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类证券（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。。

在以上战略性资产配置的基础上，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相补充的方法，确定资产在非信用类固定收益类证券（国家债券、中央银行票据等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例。

（2）固定收益类证券投资策略

本基金的主要投资策略是买入与封闭期相匹配的债券，并持有到期，或者是持有回售期与封闭期相匹配的债券，获得本金和票息收入；同时，根据所持债券信用状况

变化，进行必要的动态调整；在谨慎投资的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

对于本基金投资的固定收益类证券，主要从四个层次进行独立、客观、综合的考量，以筛选出合适的投资标的。

第一，基于全部公开信息对已经上市或待上市债券的发行主体进行研究，内容主要涉及发行人的股东背景、行业地位及发展趋势、担保方式及担保资产、外部增信质量、自由现金流量动态、债务压力、再融资能力等，并从以上角度对发行主体进行精细化分析和归类，规避同一信用等级中外部评级偏高以及信用风险偏高的个券，甄选同一信用评级中内生资质及外部增信好的个券，纳入债券池。

第二，使用基金管理人内部的信用评估体系对备选个券进行评分，着重考察发行人的偿债能力、现金管理能力、盈利能力三个核心要素。

第三，对市场同类可比债券、信用收益率曲线、市场交易活跃度、机构需求进行偏好分析，对个券进行流动性风险、信用风险的综合定价，判断其合理估值水平。

第四，根据市场结构与需求特征，在前三个层次的分析基础上，对个券进行深入的跟踪分析，发掘其中被市场低估的品种，在控制流动性风险的前提下，对低估品种进行择机配置和交易。

针对中小企业私募债，本基金以持有到期，获得本金和票息收入为主要投资策略，同时，密切关注债券的信用风险变化，力争在控制风险的前提下，获得较高收益。

针对资产支持证券，本基金将在国内资产证券化具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整收益高的品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散，以降低流动性风险。

（3）杠杆投资策略

本基金将综合考虑债券投资的风险收益以及回购成本等因素，在严格控制投资风险的前提下，通过正回购，获得杠杆放大收益。开放期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；封闭期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%。

2、开放期投资策略

开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。

四、投资决策流程

投资决策委员会是本基金的最高决策机构，定期或遇重大事件时就投资管理业务的重大问题进行讨论，并对本基金投资做方向性指导。基金经理、研究员、交易员等各司其责，相互制衡。具体的投资流程为：

1、投资决策委员会定期召开会议，确定本基金的总投资思路和投资原则；

2、宏观策略部基于自上而下的研究为本基金提供建议；研究部行业研究员为行业研究与分析提供支持；固定收益部数量及信用分析员为固定收益类投资决策提供依据；

3、固定收益部定期召开投资例会，根据投资决策委员会的决定，结合市场和个券的变化，制定具体的投资策略；

4、基金经理依据投委会的决定，参考研究员的投资建议，结合风险控制和业绩评估的反馈意见，根据市场情况，制定并实施具体的投资组合方案；

5、基金经理向交易员下达指令，交易员执行后向基金经理反馈；

6、监察法律部对投资的全过程进行合规风险监控；

7、风险管理部通过行使风险管理职能，测算、分析和监控投资风险,根据风险限额管理政策防范超预期风险；

8、风险管理部对基金投资进行风险调整业绩评估，定期与基金经理讨论收益和风险预算。

五、投资限制

（一）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1、承销证券；
- 2、违反规定向他人贷款或者提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- 5、向其基金管理人、基金托管人出资；
- 6、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 7、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动；

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，则本基金可不受上述规定的限制。

（二）投资组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- 1、本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，

为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；

2、开放期内保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制；

3、本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

4、本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

5、本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

6、本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

7、本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

8、本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

9、本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

10、本基金在封闭期内投资中小企业私募债券的剩余期限，不得超过本基金的剩余封闭运作期；本基金在开放期内投资中小企业私募债券的剩余期限，不得超过投资日至下一封闭期到期日的期限；

11、本基金持有的中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 30%，其中单只中小企业私募债券市值不得超过基金资产净值的 3%；

12、开放期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；封闭期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%；

13、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当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基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，则本基金投资可不再受相关限制或以变更后的规定为准。

六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：1年期定期存款利率（税后）×150%。每个封闭期首日，1年期定期存款利率根据当日中国人民银行公布并执行的利率水平调整。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时，本基金管理人在与基金托管人协商一致，可调整或变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

七、风险收益特征

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金，属于中等风险/收益的产品。

八、基金管理人代表基金行使债权人权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、有利于基金财产的安全与增值；
- 3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

九、基金投资组合报告

博时基金管理公司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。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的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。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。**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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 3,447,444,011.20 | 97.02 |
| | 其中：债券 | 3,447,444,011.20 | 97.02 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 54,284,981.99 | 1.53 |
| 7 | 其他各项资产 | 51,478,911.90 | 1.45 |
| 8 | 合计 | 3,553,207,905.09 | 100.00 |

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

3 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股票投资明细

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 1,014,864,837.80 | 41.76 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 226,395,000.00 | 9.32 |
| | 其中：政策性金融债 | 226,395,000.00 | 9.32 |
| 4 | 企业债券 | 853,191,173.40 | 35.11 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 473,016,000.00 | 19.46 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 879,977,000.00 | 36.21 |
| 10 | 合计 | 3,447,444,011.20 | 141.85 |

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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|--------------------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 019526 | 15 国债 26 | 3,600,000 | 365,724,000.00 | 15.05 |
| 2 | 019516 | 15 国债 16 | 2,500,000 | 262,975,000.00 | 10.82 |
| 3 | 1523009 | 15 安邦人 寿 | 2,100,000 | 209,832,000.00 | 8.63 |
| 4 | 101573023 | 15 中信国 安 MTN004 | 2,000,000 | 204,960,000.00 | 8.43 |
| 5 | 136045 | 15 复地 01 | 2,000,000 | 201,400,000.00 | 8.29 |

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。

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。

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。

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。

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。

11 投资组合报告附注

11.1 报告期内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。

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。

11.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 350,703.57 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 51,128,208.33 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 51,478,911.90 |

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可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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。

第九部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

自基金合同生效开始，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 |
|---------------------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 2015. 11. 24-2015. 12. 31 | 2.70% | 0.11% | 0.23% | 0.00% | 2.47% | 0.10% |
| 2016. 1. 1-2016. 3. 31 | 2.43% | 0.14% | 0.56% | 0.01% | 1.87% | 0.13% |
| 2015. 11. 24-2016. 3. 31 | 5.20% | 0.13% | 0.79% | 0.01% | 4.41% | 0.13% |

第十部分 基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指购买各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

第十一部分 基金资产的估值

一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

二、估值对象

基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

三、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 除本部分另有约定的品种外,交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(本合同另有规定的除外),选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值,具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定;

(3) 交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

2、首次公开发行未上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

5、中小企业私募债券,采用估值技术确定公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任

方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

六、暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

七、基金净值的确认

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，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按规定对基金净值予以公布。

八、特殊情况的处理

1.基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2.由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

第十二部分 基金的收益与分配

一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

三、基金收益分配原则

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资（红利再投资不受封闭期限制）；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、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；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

第十三部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的账户开户费用和账户维护费；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式在月初三个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.18%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.18\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第3—9项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、证券账户开户费用：证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后，自产品成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付，如基金财产余额不足支付该开户费用，由基金管理人于产品成立一个月后的5个工作日内进行垫付，基金托管人不承担垫付开户费用义务。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分 基金的会计与审计

一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

第十五部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定媒介和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送

更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

（二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

（三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

（四）基金资产净值、基金份额净值

在基金封闭期内，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在基金开放期每个开放日的次日，基金管理人应通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

（五）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

（六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

（七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止《基金合同》；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金销售机构；
- 20、更换基金登记机构；
- 21、本基金进入开放期；
- 22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、本基金发生巨额赎回并延期支付；

- 24、本基金暂停接受申购、赎回申请；
- 25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、中国证监会规定的其他事项。

(八) 澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

(九) 基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

(十) 投资于中小企业私募债券的信息披露

1、基金管理人应当在基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。

2、基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

(十一) 资产支持证券的投资情况

基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

(十二) 中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机

构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

七、信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、不可抗力；
- 2、发生暂停估值的情形；
- 3、法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的情况。

第十六部分 风险揭示

一、投资于本基金的主要风险

1、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

（1）政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

（2）经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于债券，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

（3）利率风险。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券，其收益水平会受到利率变化的影响。在利率上升时，基金持有的债券价格下降，如基金组合久期较长，则将造成基金资产的损失。

（4）购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

（5）再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比以前较少的收益率，这将对基金的净值增长率产生影响。

（6）信用风险。基金所投资债券的发行人如出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将造成基金资产损失。

（7）债券回购风险。债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对基金组合收益进行放大的同时，也对基金组合的波动性（标准差）进行了放大，即基金组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

2、管理风险

基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或基金管理人内部失控而可能产生的损失。管理风险包括：

（1）决策风险：指基金投资的投资策略制定、投资决策执行和投资绩效监督检查过程中，由于决策失误而给基金资产造成的可能的损失；

(2) 操作风险：指基金投资决策执行中，由于投资指令不明晰、交易操作失误等人为因素而可能导致的损失；

(3) 技术风险：是指基金管理人管理信息系统设置不当等因素而可能造成的损失。

3、流动性风险

在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

4、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

5、本基金特有风险

(1) 根据本基金投资范围的规定，本基金主要投资于各类固定收益证券，无法完全规避发债主体特别是短期融资券、中期票据、公司债、企业债的发债主体的信用质量变化造成的信用风险；另外，如果持有的信用债出现信用违约风险，将给基金净值带来较大的负面影响和波动。

(2) 本基金的封闭期为自《基金合同》生效之日起（包括《基金合同》生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）18个月的期间。在本基金的封闭运作期间，基金份额持有人不能赎回基金份额，因此，若基金份额持有人错过某一开放期而未能赎回，其份额将转入下一封闭期，至下一开放期方可赎回。

(3) 本基金开放期内单个开放日出现巨额赎回的，基金管理人对符合法律法规及《基金合同》约定的赎回申请应于当日全部予以办理和确认。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金在单个开放日出现巨额赎回被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人仍有可能存在延缓支付赎回款项的风险，未赎回的基金份额持有人仍有可能承担短期内变现而带来的冲击成本对基金净资产产生的负面影响。

(4) 在每个开放期结束日次日，如出现《基金合同》第五部分第三条约定的资产规模过小、基金份额持有人人数较少等情形的，《基金合同》将终止。

(5) 本基金的一部分资产将可能投资于中小企业私募债券。由于中小企业私募债券发行门槛低，投资过程中的信用风险也相应增加。有可能出现债券到期后，企业不能按时清偿债务，或者在存续期内评级被下调的风险。中小企业私募债券不能在交易所上市交易，而是通过上证所固定收益证券综合电子平台及深交所综合协议交易平台，或证券公司进行转让，同时，交易所按照申报时间先后顺序对私募债券转让进行确认，对导致私募债券投资者超过200人的转让不予确认。因此，本基金在投资中小企业私募债券的过程中，面临着流动性风险。

6、其他风险

(1) 随着符合本基金投资理念的新投资工具的出现和发展，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

(2) 因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

(3) 因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

(4) 因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

(5) 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

(6) 战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

(7) 其他意外导致的风险。

二、声明

1、投资者投资于本基金，须自行承担投资风险；

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金销售机构代理销售，基金管理人与基金代销机构都不能保证其收益或本金安全。

第十七部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

第十八部分 基金合同的内容摘要

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) 基金份额持有人的权利、义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 在开放期内依法申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 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，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的

有限责任；

- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 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、法规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、法规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，将已募集资金并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。

(三) 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、基金份额申购、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，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 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；

(18) 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和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 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、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平

等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

一、召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》，基金合同另有约定的除外；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率或变更收费方式；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- (6) 调整本基金份额类别的设置；
- (7) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

二、会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，依据有关规定进行公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、授权方式、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

(7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

四、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规及监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为

基金管理人)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的,不影响表决效力;

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的,基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一);若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见;

(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下,经会议通知载明,本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会;在会议召开方式上,本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决,具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

五、议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持

人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时监督员及公证机关均认为有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

七、计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应

当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

八、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金合同的解除和终止的事由、程序及基金财产清算方式

一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

四、争议解决方式

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交华南国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为深圳市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

第十九部分 基金托管协议的内容摘要

一、托管协议当事人

(一) 基金管理人

名称：博时基金管理有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

法定代表人：张光华

成立时间：1998 年 7 月 13 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【1998】26 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

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。

(二) 基金托管人

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 252.198 亿元

存续期间：持续经营。

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定以及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资比例、投资风格、投资限制、关联方交易等，进行严格监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应事先或定期向基金托管人提供投资品种池，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。

1. 本基金的投资范围

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国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、中小企业私募债券、短期融资券及超级短期融资券、可分离交易债券的纯债、资产支持证券、回购和银行定期存款等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类证券(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

2. 本基金各类品种的投资比例、投资限制为：

本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；

(2) 开放期内保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(4) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净

值的 10%；

(5) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(6) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(7) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(8) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(9) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(10) 本基金在封闭期内投资中小企业私募债券的剩余期限，不得超过本基金的剩余封闭运作期；本基金在开放期内投资中小企业私募债券的剩余期限，不得超过投资日至下一封闭期到期日的期限；

(11) 本基金持有的中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 30%，其中单只中小企业私募债券市值不得超过基金资产净值的 3%；

(12) 开放期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；封闭期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%；

(13) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当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基金合同的有关约定。在上述期间，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

3. 本基金财产不得用于以下投资或者活动：

(1) 承销证券；

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资；

(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

4. 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。对于不符合规定的银行存款，基金托管人可以拒绝执行，并通知基金管理人。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

1. 本基金的存款银行应是具有证券投资基金托管资格、证券投资基金销售业务资格或合格境外基金投资人托管人资格的商业银行。

2. 本基金投资定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%，根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，不受此限制；存放在具有基金托管资格的同一银行存款不得超过基金资产净值的 30%。

有关法律法规或监管部门制定或修改新的定期存款投资政策，基金公司履行适当程序后，可相应调整投资组合限制的规定。

3. 基金管理人负责对本基金存款银行的评估与研究，建立健全银行定期存款的业务流程、岗位职责、风险控制措施和监察稽核制度，切实防范有关风险。基金托管人负责对本基金银行定期存款业务的监督与核查，审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

(1) 基金管理人负责控制信用风险。信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。

(2) 基金管理人负责控制流动性风险。流动性风险主要包括基金管理人要求全部提前支取、部分提前支取或到期支取而存款银行未能及时兑付的风险、基金投资银行存款不能满足基金正常结算业务的风险、因全部提前支取或部分提前支取而涉及的利息损失影响估值等涉及到基金流动性方面的风险。

(3) 基金管理人须加强内部风险控制制度的建设。如因基金管理人员的个人行为导

致基金财产受到损失的，需由基金管理人承担由此造成的损失。

(4) 基金管理人投资银行存款时，应就相关事宜在更新招募说明书中予以披露，进行风险揭示。

(5) 基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

(三) 基金投资银行存款协议的签订、账户开设与管理、投资指令与资金划拨、账目核对、到期兑付、提前支取和文件保管

1. 基金投资银行存款协议的签订

(1) 符合资格的存款银行，基金管理人应与存款银行总行或其授权分行签订《基金存款业务总体合作协议》（以下简称《总体合作协议》），确定《存款协议书》的格式范本。《总体合作协议》和《存款协议书》的格式范本由基金托管人与基金管理人共同商定。

(2) 基金管理人应在《存款协议书》中明确存款证实书或其他有效存款凭证的办理方式、邮寄地址、联系人和联系电话，以及存款证实书或其他有效凭证在邮寄过程中遗失后，存款余额的确认及兑付办法。

(3) 由存款银行指定的存放存款的分支机构（以下简称“存款分支机构”）寄送存款证实书或其他有效存款凭证的，基金管理人应在《存款协议书》中规定基金托管人可向存款分支机构的上级行发出存款余额询证函，存款分支机构及其上级行应予配合。

(4) 基金管理人应在《存款协议书》中规定，基金存放到期或提前兑付的资金应全部划转到指定的基金托管账户，并在《存款协议书》写明账户名称和账号，未划入指定账户的，由存款银行承担一切责任。

(5) 基金托管人依据相关法规对《总体合作协议》和《存款证实书》的内容进行复核，审查存款银行资格等。

2. 基金投资银行存款时的账户开设与管理

(1) 基金投资于银行存款时，基金管理人应当依据基金管理人与存款银行签订的《总体合作协议》，以基金的名义在存款银行总行或授权分行指定的分支机构开立银行账户。

(2) 银行存款的预留印鉴由基金托管人保管和使用。

3. 存款投资指令的发送与执行

(1) 基金管理人发送投资指令应采用传真方式或双方约定的其他方式。

存款投资指令包括存款资金划拨指令、提前支取存款指令等。

基金管理人应按照法律法规和基金合同及托管协议的规定向基金托管人发送存款投资指令。对于基金管理人依约定程序发出的指令，基金管理人不得否认其效力。

指令发出后，基金管理人应及时以电话方式向基金托管人确认。

基金管理人在发送投资指令时，应为基金托管人执行投资指令留出执行指令所必需的时间。投资指令传输不及时、未能留出足够的划款时间，导致资金未能及时到账所造成的损失

由基金管理人承担。

(2) 投资指令的确认

基金托管人应指定专人接收基金管理人的指令，预先通知基金管理人其名单，并与基金管理人商定指令发送和接收方式。投资指令到达基金托管人后，基金托管人应指定专人立即审慎验证有关内容及印鉴和签名的表面一致性。

(3) 投资指令的执行

基金托管人验证投资指令后，应及时执行。

若因基金托管人过错致使资金未能及时到账或者投资指令执行差错所造成的损失由基金托管人承担。

若基金托管人未能执行或仅可部分执行投资指令(无论因基金托管人原因还是基金管理人原因)，基金托管人应及时电话通知基金管理人。

4. 资金划拨、账目核对及到期兑付

(1) 资金划拨

基金管理人的划拨指令，经基金托管人审核无误后应在规定期限内执行。存款资金只能存放于存款银行总行或者其授权分行指定的分支机构。

(2) 存款证实书等存款凭证领取

存款银行分支机构应为基金开具存款证实书或其他有效存款凭证名称，该存款证实书为基金托管人存款确认或到期提款的有效凭证。资金到账当日，由存款银行分支机构指定的会计主管传真一份存款证实书复印件并与基金托管人电话确认收妥后，用特快专递将存款证实书原件寄送基金托管人指定联系人；若开户行代为保管存单的，由存款行分支机构指定会计主管传真一份存款证实书复印件并与基金托管人电话确认收妥。

(3) 存款证实书等存款凭证的遗失补办

存款证实书在邮寄过程中遗失的，由基金托管人向存款银行提出补办申请，基金管理人应督促存款银行尽快补办存款证实书或基金托管人兑付时可作为兑付依据的存款证明文件，并按以上(2)的方式以特快专递方式邮寄给托管人。

(4) 账目核对

每个工作日，基金管理人应与基金托管人核对各项银行存款投资余额及应计利息。

定期存款行应配合基金托管人招商银行股份有限公司对“存款证实书”的询证，并在询证函上加盖定期存款行公章寄送至基金托管人指定联系人。

(5) 到期兑付

基金管理人提前通知基金托管人通过特快专递将存款证实书原件或其他存款证明原件寄给存款银行分支机构指定的会计主管。存款行未收到存款证实书原件的，应与基金托管人电话询问。存款到期前基金管理人与存款行确认存款证实书收到并于到期日兑付存款本息事宜。

基金托管人在存款到期日未收到存款本息或存款本息金额不符时,通知基金管理人与存款行接洽存款到账时间及利息补付事宜。基金管理人应将接洽结果告知基金托管人,基金托管人收妥存款本息的当日通知基金管理人。

存款证实书在邮寄过程中遗失的,存款行应立即通知基金托管人,基金托管人在原存款证实书复印件上加盖公章并出具相关证明文件后,与存款行指定会计主管电话确认后,存款行分支机构应在到期日将存款本息划至指定基金的资金账户。

如果存款到期日为法定节假日,存款行顺延至到期后第一个工作日支付,存款行需按当期利率和实际延期天数支付延期利息。

5. 提前支取

如果在存款期限内,由于基金规模发生缩减的原因或者出于流动性管理的需要等原因,经向存款行说明理由,基金管理人可以提前支取全部或部分资金,但应继续按原有利率计提利息,因提前支取导致的利息损失应由基金管理人承担。

提前支取的具体事项按照基金管理人与存款行签订的《存款协议书》执行。

6. 基金投资银行存款的相关文件保管

(1) 基金资金存入存款银行当日,存款行分支机构开具存款证实书或其他有效存款凭证,同时传真复印件给基金托管人和基金管理人,并寄送原件给基金托管人代为保管;若存款行代为保管存单原件,存款行传真复印件给基金托管人和基金管理人。

(2) 存款证实书或其他有效存款凭证原件由基金托管人保管。基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及《基金合同》的约定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正或拒绝结算,若基金管理人拒不执行造成基金财产的损失,基金托管人不承担任何责任。

(四) 本基金投资中小企业私募债券的应符合证监会《关于证券投资基金投资中小企业私募债券有关问题的通知》等有关法律法规的规定。

1. 基金管理人应在基金首次投资中小企业私募债券前,向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资中小企业私募债券的投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案、信用风险处置预案等。

2. 基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内,以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

3. 基金管理人对本基金投资中小企业私募债券的流动性风险负责,确保对相关风险采取积极有效的措施,在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时,基金管理人应保证提供足额现金确

保基金的支付结算。

4. 基金托管人有权根据基金管理人制定的风险控制制度对基金管理人投资中小企业私募债券的额度和比例进行监督。如果基金管理人对相应风险控制制度进行修改的,应及时修订后通知基金托管人。

5. 基金托管人对基金投资中小企业私募债券是否符合比例限制进行事后监督,如发现异常情况,应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人接到通知后应及时核对并向基金托管人说明原因和解决措施。基金托管人有权随时对所通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

6. 如因市场变化,基金管理人投资的中小企业私募债券超过投资比例的,基金托管人有权要求基金管理人在 10 个工作日内将中小企业私募债券调整至规定的比例要求。

(五) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人有责任确保及时将更新后的交易对手名单发送给基金托管人,否则由此造成的损失应由基金管理人承担。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。在基金存续期间基金管理人可以调整交易对手名单,但应将调整结果至少提前一个工作日书面通知基金托管人。新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场需要临时调整银行间债券交易对手名单及结算方式的,应向基金托管人说明理由,并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失。若未履约的交易对手在基金管理人确定的时间内仍未承担违约责任及其他相关法律责任的,基金管理人可以对相应损失先行予以承担,然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人,基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

(六) 本基金投资流通受限证券,应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

1. 本协议所称的流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

本基金可以投资经中国证监会批准的非公开发行证券,且限于由中国证券登记结算有限

责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管的，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

基金不得投资未经中国证监会批准的非公开发行证券。

基金参与非公开发行证券的认购，不得预付任何形式的保证金，法律法规或中国证监会另有规定的除外。

基金不得投资有锁定期但锁定期不明确的证券，但法律法规或中国证监会另有规定的除外。

2. 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

基金管理人对本基金投资流通受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。

3. 基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、应划付的认购款、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

由于基金管理人未及时提供有关证券的具体的必要的信息，致使托管人无法审核认购指令而影响认购款项划拨的，基金托管人免于承担责任。

4. 基金托管人依照法律法规、《基金合同》、《托管协议》审核基金管理人投资流通受限证券的行为。如发现基金管理人违反了《基金合同》、《托管协议》以及其他相关法律法规的有关规定，应及时通知基金管理人，并呈报中国证监会，同时采取合理措施保护基金投资人的利益。基金托管人有权对基金管理人的违法、违规以及违反《基金合同》、《托管协议》的投资指令不予执行，并立即通知基金管理人纠正，基金管理人不予纠正或已代表基金签署合同不得不执行时，基金托管人应向中国证监会报告。

(七) 基金管理人应当对投资中期票据业务进行研究，认真评估中期票据投资业务的风险，本着审慎、勤勉尽责的原则进行中期票据的投资业务。基金管理人根据法律、法规、

监管部门的规定，制定了经公司董事会批准的《中期票据投资管理办法》（以下简称《制度》），以规范对中期票据的投资决策流程、风险控制。基金管理人《制度》的内容与本协议不一致的，以本协议的约定为准。

1. 基金投资中期票据应遵循以下投资限制：

（1）中期票据属于固定收益类证券，基金投资中期票据应符合法律、法规及《基金合同》中关于该基金投资固定收益类证券的相关比例；

（2）基金管理人管理的全部公募基金投资于一家企业发行的单期中期票据合计不超过该期证券的 10%。

2. 基金托管人对基金管理人流动性风险处置的监督职责限于：

基金托管人对基金投资中期票据是否符合比例限制进行事后监督，如发现异常情况，应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人接到通知后应及时核对并向基金托管人说明原因和解决措施。基金托管人有权随时对所通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

3. 如因市场变化，基金管理人投资的中期票据超过投资比例的，基金托管人有权要求基金管理人在 10 个交易日内将中期票据调整至规定的比例要求，但中国证监会规定的特殊情形除外。

（八）基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行复核。

（九）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应及时核对并回复基金托管人，对于收到的书面通知，基金管理人应以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

（十）基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。包括但不限于：对基金托管人发出的提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（十一）若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人及时纠正，由此造成

的损失由基金管理人承担。

(十二) 基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为, 应及时报告中国证监会, 同时通知基金管理人限期纠正。

三、基金管理人对于基金托管人的业务监督、核查

(一) 基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查, 核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(二) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时, 应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函, 说明违规原因及纠正期限, 并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内, 基金管理人有权随时对通知事项进行复查, 督促基金托管人改正。

(三) 基金托管人有义务配合和协助基金管理人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查, 包括但不限于: 对基金管理人发出的书面提示, 基金托管人应在规定时间内答复并改正, 或就基金管理人的疑义进行解释或举证; 基金托管人应积极配合提供相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性。

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

四、基金财产的保管

(一) 基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
2. 基金托管人应安全保管基金财产。
3. 基金托管人按照规定开设基金财产投资所需的相关账户。
4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户, 独立核算、分账管理, 确保基金财产的完整与独立。
5. 基金托管人根据基金管理人的指令, 按照基金合同和本协议的约定保管基金财产。未经基金管理人的正当指令, 不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。不属于基金托管人实际有效控制下的资产及实物证券等在基金托管人保管期间的损坏、灭失, 基金托管人不承担由此产生的责任。
6. 对于因为基金投资产生的应收资产, 应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日

期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。基金管理人未及时催收给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失。

7 基金托管人对因为基金管理人投资产生的存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产，或交由期货公司或证券公司负责清算交收的委托资产（包括但不限于期货保证金账户内的资金、期货合约等）及其收益；由于该等机构或该机构会员单位等本协议当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给委托财产造成的损失等不承担责任。

8. 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

（二）基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间募集的资金应开立“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2. 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的基金资金账户，同时在规定时间内，基金管理人应聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

3. 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

（三）基金资金账户的开立和管理

1. 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的资金账户（也可称为“托管账户”），保管基金的银行存款，并根据基金管理人的指令办理资金收付。托管账户名称应为“博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金”，预留印鉴为基金托管人印章。

2. 基金资金账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金资金账户的开立和管理应符合法律法规及银行业监督管理机构的有关规定。

（四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1. 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为本基金开立基金托管人与本基金联名的证券账户。

2. 基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4. 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金

账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，按有关规定开立、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

（五）债券托管账户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，以基金的名义在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。

（六）其他账户的开立和管理

1. 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金管理人协助基金托管人按照有关法律法规和本协议的约定协商后开立。新账户按有关规定使用并管理。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证按约定由基金托管人存放于基金托管人的保管库，或存入银行间市场登记结算机构、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，实物保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由上述存放机构及基金托管人以外机构实际有效控制的有价凭证不承担保管责任。

（八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。因基金管理人发送的合同传真件与事后送达的合同原件不一致所造成的后果，由基金管理人负责。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

五、基金资产净值计算与复核

（一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1. 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到

0.001 元，小数点后第四位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

2. 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金资产净值、基金份额净值发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。

3. 根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称、证件号码和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法律法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金管理人和托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

七、争议解决方式

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交华南国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为深圳市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

八、托管协议的修改与终止

（一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更应报中国证监会备案。

（二）基金托管协议终止出现的情形

1、《基金合同》终止；

2、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6

个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

3、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

4、发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

(三) 基金财产的清算

基金管理人与基金托管人按照《基金合同》的约定处理基金财产的清算。

第二十部分 对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、基金销售机构提供。基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加和修改服务项目，主要提供的服务内容如下：

（一）基金份额持有人交易资料的寄送服务

1、正常开放期，每次交易结束后，对 T 日提交的有效申请，投资者可在 T+2 日后通过销售机构的网点查询和打印交易确认单，或在 T+1 日后通过博时一线通电话、博时网站查询交易确认情况。基金管理人向投资者寄送交易确认单。

2、每季度结束后 10 个工作日内，基金管理人向本季度有交易的投资者寄送纸质对账单；每年度结束后 15 个工作日内，基金管理人向所有持有本基金份额的投资者寄送纸质对账单。

3、每月结束后，基金管理人向所有订阅电子邮件对账单的投资者发送电子邮件对账单。

投资者可以登录基金管理人网站（<http://www.bosera.com>）自助订阅；或发送“订阅电子对账单”邮件到客服邮箱 service@bosera.com；也可直接拨打博时一线通 95105568（免长途话费）订阅。

（二）网上理财服务

通过基金管理人网站，投资者可获得如下服务：

1、自助开户交易：投资者使用建设银行、农业银行、工商银行、中国银行、交通银行、招商银行、兴业银行、浦发银行、邮储银行、民生银行、中信银行、光大银行、平安银行、广发银行、华夏银行、上海银行的借记卡或招商银行 i 理财账户、汇付天下天天盈账户、支付宝理财专户均可以在基金管理人网站上自助开户并进行网上交易。

2、查询服务：投资者可以通过基金管理人网站查询所持有基金的基金份额、交易记录等信息，同时可以修改基金账户信息等基本资料。

3、信息咨询服务：投资者可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管理人最新动态、热点问题等。

4、在线客服：投资者可以点击基金管理人网站首页“在线客服”，与客服代表进行在线咨询互动。也可以在“您问我答”栏目中，直接提出有关本基金的问题和建议。

（三）短信服务

基金管理人向订制短信服务的基金份额持有人提供相应短信服务。

（四）电子邮件服务

基金管理人为投资者提供电子邮件方式的业务咨询、投诉受理、基金份额净值等服务。

（五）手机理财服务

投资者通过手机访问博时 WAP 网站（<http://wap.bosera.com>）、博时移动版直销网上交易系统（<http://m.bosera.com>）和博时 App 版直销网上交易系统，可以使用基金理财所需的基金交易、理财查询、账户管理、信息资讯等功能和服务。

（六）信息订阅服务

投资者可以通过博时网站、客服中心提交信息订制的申请，基金管理人将以电子邮件、手机短信的形式定期为投资者发送所订制的信息。

（七）电话理财服务

投资者拨打博时一线通：95105568（免长途话费）可享有投资理财交易的一站式综合服务：

1、自助语音服务：基金管理人自助语音系统提供 7×24 小时的全天候服务，投资者可以自助查询账户余额、交易情况、基金净值等信息，也可以进行直销交易、密码修改、传真索取等操作。

2、电话交易服务：基金管理人直销投资者可通过博时一线通电话交易平台在线办理基金的认购、申购、赎回、转换、变更分红方式、撤单等直销交易业务，其中已开通协议支付账户的投资者还可以在线完成认/申购款项的自动划付。

3、人工电话服务：投资者可以获得业务咨询、信息查询、资料修改、投诉受理、信息订制、账户诊断等服务。

4、电话留言服务：非人工服务时间或线路繁忙时，投资者可进行电话留言。

基金管理人的互联网地址及电子信箱

网址：www.bosera.com

电子信箱：service@bosera.com

（八）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

第二十一部分 招募说明书存放及查阅方式

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制；投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件或复印件。对投资者按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站（www.bosera.com）查阅和下载招募说明书。

第二十二部分 其他应披露的事项

- (一)、2016 年 04 月 27 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加德州银行股份有限公司为代销机构并参加其申购及定投费率优惠活动的公告》；
- (二)、2016 年 04 月 22 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告》；
- (三)、2016 年 04 月 20 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加北京懒猫金融信息服务有限公司为代销机构的公告》；
- (四)、2016 年 04 月 15 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金分红公告》；
- (五)、2016 年 04 月 15 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时安誉 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金分红公告》；
- (六)、2016 年 03 月 29 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加北京惠次方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》；
- (七)、2016 年 03 月 28 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》；
- (八)、2016 年 03 月 25 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加海银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》；
- (九)、2015 年 12 月 26 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于《博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告》的补充说明》；
- (十)、2015 年 11 月 25 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告》；
- (十一)、2015 年 11 月 20 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时安荣 18 个月债券型证券投资基金提前结束募集的公告》；

(十二)、2015 年 11 月 16 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金新增代销机构的公告》；

(十三)、2015 年 11 月 12 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金份额发售公告》；

(十四)、2015 年 11 月 12 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于《博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金份额发售公告》的补充公告》；

(十五)、2015 年 11 月 11 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金份额发售公告》；

(十六)、2015 年 11 月 11 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时安荣 18 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；

(十七)、2015 年 11 月 11 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时安荣 18 个月定期开放债券基金托管协议》；

(十八)、2015 年 11 月 11 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时安荣 18 个月定期开放债券基金基金合同》；

第二十三部分 备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

- (一) 中国证监会准予博时安荣18个月定期开放债券型注册的文件
- (二) 《博时安荣18个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《博时安荣18个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (五) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (六) 法律意见书
- (七) 中国证监会要求的其他文件

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。

博时基金管理有限公司

2016年7月8日