

# **博时现金收益证券投资基金 更新招募说明书**

**2011 年第 1 号**

**基金管理人：博时基金管理有限公司**

**基金托管人：交通银行股份有限公司**

**送出日期：2011 年 3 月**

## 重要提示

博时现金收益证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会于 2003 年 12 月 5 日证监基金字（2003）134 号文批准公开发行。本基金的基金合同于 2004 年 1 月 16 日正式生效。本基金为契约型开放式。

博时基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值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。

投资者在办理基金业务时提交的资料信息须真实、有效。于交易日（T 日）提交的申请，投资者应在 T+2 日到销售网点柜台或销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况，投资者提交的申请经注册登记人确认（或不被确认）的后果由投资者承担。

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。

投资有风险，过往业绩并不代表将来业绩。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。

投资者在申购本基金前应认真阅读本招募说明书。

基金招募说明书自基金合同生效日起，每 6 个月更新一次，并于每 6 个月结束之日后的 45 日内公告，更新内容截至每 6 个月的最后 1 日。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2011 年 1 月 16 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2010 年 12 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

重要提示.....	2
一. 绪言.....	4
二. 释义.....	4
三. 基金管理人.....	7
四. 基金托管人.....	15
五. 相关服务机构.....	18
六. 基金的募集与基金合同的生效.....	44
七. 基金的申购与赎回和转换.....	45
八. 基金的非交易过户与转托管.....	49
九. 基金的投资.....	49
十. 基金的业绩.....	56
十一. 基金的财产.....	56
十二. 基金资产计价.....	57
十三. 基金收益与分配.....	59
十四. 基金的费用与税收.....	60
十五. 基金的会计与审计.....	62
十六. 基金的信息披露.....	63
十七. 风险揭示.....	65
十八. 基金合同的终止与清算.....	66
十九. 基金合同内容摘要.....	67
二十. 托管协议内容摘要.....	77
二十一. 对基金份额持有人的服务.....	84
二十二. 其它应披露的事项.....	86
二十三. 招募说明书的存放及查阅方式.....	87
二十四. 备查文件.....	87

## 一. 绪言

博时现金收益证券投资基金（以下简称“本基金”）由博时基金管理有限公司（“本基金管理人”或“管理人”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、等相关法律法规、中国证监会发布的有关规定以及《博时现金收益证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其它有关规定发起设立。

本招募说明书依据《基金法》、《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》）、《基金合同》及其它有关规定等编写。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。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，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，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。基金投资人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。

## 二. 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：

基金或本基金	指博时现金收益证券投资基金
基金合同或本基金合同	指《博时现金收益证券投资基金基金合同》及对《博时现金收益证券投资基金基金合同》的任何修订和补充，根据最新法律法规，原基金契约均改称为基金合同，但是在对基金合同的摘要中仍根据原文摘录
托管协议	指《博时现金收益证券投资基金托管协议》及协议当事人对其不时作出的补充及修订
招募说明书	指《博时现金收益证券投资基金招募说明书》。招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。基金招募说明书自基金合同生效日起，每 6 个月更新一次，并于每 6 个月结束之日后的 45 日内公告，更新内容截至每 6 个月的最后 1 日

发行公告	指《博时现金收益证券投资基金发行公告》
《证券法》	指 2005 年 10 月 27 日第十届全国人民代表大会常务委员会第十八次会议修订并于 2006 年 1 月 1 日实施的《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时作出的修订
《基金法》	指 2003 年 10 月 28 日由第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日开始实施的《中华人民共和国证券投资基金法》
《运作办法》	指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》
《销售管理办法》	指中国证监会 2004 年 6 月 4 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》
《信息披露办法》	指中国证监会 2004 年 6 月 10 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》
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
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
基金合同当事人	指受本基金合同约束，根据基金合同享受权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
基金管理人	指博时基金管理有限公司
基金托管人	指交通银行股份有限公司
注册登记业务	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、基金份额注册登记、基金交易确认、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等
注册登记人	指办理基金登记、注册、过户、清算和结算业务的机构，本基金的注册登记人指博时基金管理有限公司
销售服务代理人	指符合中国证监会有关规定的条件并与基金管理人签订了销售服务代理协议，代为办理基金销售服务业务的机构，简称代销人
销售人	指博时基金管理有限公司和代销人
基金投资者	指个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者
个人投资者	指依法可以投资开放式证券投资基金的中国公民
机构投资者	指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国

合格境外机构投资者	境内合法注册登记或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织以及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》规定的条件，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
基金份额持有人	指依法或依基金合同、招募说明书取得基金份额的投资者
元	指人民币元
基金成立日	指基金达到成立条件后，基金管理人宣布基金成立的日期
基金合同生效日	指本基金募集符合基金合同规定的条件，并获得中国证监会书面确认之日
基金合同终止日	指基金合同规定的终止事由出现后按照基金合同规定的程序并经中国证监会批准终止基金合同的日期
存续期	指基金合同生效至终止之间的不定期期限
开放日	指销售人为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日
工作日	指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
T 日	指销售人确认的投资者有效申请工作日
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日，不包含 T 日
申购	指基金合同生效后，投资者通过销售人向基金管理人购买基金份额的行为
赎回	指基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回基金份额的行为
巨额赎回	指在本基金单个开放日内，基金净赎回申请份额（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）超过上一开放日本基金总份额 10% 的情形
转换	指基金份额持有人可按规定申请将所持有的本基金份额转换为基金管理人所管理并在同一注册登记人处登记的其它开放式基金份额
转托管	指基金份额持有人申请将其在某一销售机构交易账户持有的基金份额全部或部分转出并转入另一销售机构交易账户的行为

销售与服务费	也称为持续营销和服务费用，主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、持有人服务费等，该笔费用从基金资产中扣除，属于基金的营运费用。
投资指令	指基金管理人在运用基金资产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令
基金收益	包括基金投资所得利息，买卖证券价差，存款利息以及其他合法收入
基金资产总值	指基金购买的各类证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
基金资产净值	指基金资产总值减去负债后的价值
当前累计收益	指投资人交易账户中尚未结转份额的收益
摊余成本法	即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益
基金日收益	指每万份基金份额的日收益
基金七日收益率（%）	指以最近七日（含节假日）收益所折算的年资产收益率
基金账户	指基金注册登记人为投资者开立的记录其持有博时开放式基金的基金份额及其变更情况的账户
基金交易账户	指销售人为投资者开立的记录其通过该销售人买卖博时开放式基金的基金份额、份额变动及结余情况的账户
指定媒体	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体
不可抗力	指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括：相关法律法规的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；自然或无人破坏造成的交易系统或交易场所无法正常工作；战争或动乱等

### 三. 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  
注册地址： 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层  
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： 杨 驷

成立时间： 1998 年 7 月 13 日  
注册资本： 1 亿元人民币  
存续期间： 持续经营  
联系人： 李雪松  
电 话： (0755) 83169999

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%；璟安实业有限公司，持有股份 6%；上海盛业资产管理有限公司，持有股份 6%；丰益实业发展有限公司，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 1 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。

公司下设十四个直属部门和两大销售业务体系，分别是：总裁办公室、股票投资部、特定资产管理部、固定收益部、研究部、交易部、产品规划部、市场部、基金运作部、财务部、信息技术部、监察法律部、风险管理部、人力资源部、零售业务和机构业务。总裁办公室专门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、外事活动管理、档案管理、董事会、党办及工会工作。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。特定资产管理部负责特定资产的管理和客户咨询服务。固定收益部负责进行固定收益证券的选择和组合管理。研究部负责完成对宏观经济、行业公司及市场的研究。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。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与精算等企业年金咨询工作。市场部负责基金营销策划、品牌推广等工作。基金运作部负责基金会计、基金注册登记业务。财务部负责公司财务事宜。信息技术部负责系统开发、网络运行及维护。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。风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制与流程，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和控制。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、人事信息管理工作。零售业务下辖北京区域、上海区域、南方区域、客户服务中心和电子商务部，负责公司全国范围内的零售客户、渠道销售和服务工作。其中，零售区域负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务；客户服务中心负责零售客户的服务和咨询工作；电子商务部负责公司电子商务业务的发展、各部门使用公司官方网站营销资源的归口管理和公司直销网上交易平台的建设与管理；渠道产品组负责公司的银行渠道开拓、销售推广服务工作，以及公司产品销售前包装整合工作。机构业务负责公司全国范围内的机构客户销售和服务工作。机构业务下辖养老金业务部、战略客户部、机构理财部—上海和机构理财部—南方和券商渠道组。养老金业务部负责养老金业务的研究、拓展和服务等工作。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。机构理财部一上海和机构理财部一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；券商渠道组负责券商渠道的开拓和销售服务。另设北京分公司、上海分公司、沈阳分公司和郑州分公司，分别负责对驻京、沪、沈阳、郑州人员日常行政管理和对赴京、沪、沈阳、郑州处理公务人员给予协助。

截止到 2011 年 1 月 16 日，公司总人数 323 人，其中 64% 以上的员工具有硕士以上学历。

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

杨鹁女士，硕士，董事长。1983 年起先后在中国银行国际金融研究所、香港中银集团、招商银行证券部、深圳中大投资管理公司、长盛基金管理公司、中信基金管理有限公司工作。现任招商证券股份有限公司董事、总经理。

肖风先生，博士，副董事长。历任深圳康佳电子集团股份有限公司董事会秘书兼股证委员会主任，中国人民银行深圳经济特区分行证券管理处科长、副处长，深圳市证券管理办公室副处长、处长，证管办副主任。现任博时基金管理有限公司副董事长、总经理。

汤维清先生，硕士，董事。1988 年起先后在成都探矿工艺研究所、深圳天极光电技术股份有限公司、深圳中大投资管理有限责任公司、中信基金管理有限公司工作。现任招商证券股份有限公司副总裁。

王金宝先生，硕士，董事。1988 年起先后在上海同济大学、招商证券股份有限公司工作，现任招商证券股份有限公司机构业务董事总经理。

周长青先生，硕士。历任中国人民银行银行司主任科员，中信银行支行负责人，中国民族信托投资公司理财总部副总经理，银河基金管理有限公司督察员（长）、董事会秘书等职。现任中国长城资产管理公司投资管理部副总经理。

陈小鲁先生，独立董事。1968 年起先后在中国人民解放军总参谋部、中华人民共和国驻英国大使馆、北京国际战略问题研究学会、亚龙湾开发股份有限公司、标准国际投资管理公司工作。2001 年 4 月起任博时公司独立董事。

赵榆江女士，硕士，独立董事。1978 年起先后在中华人民共和国外交部、国家经济体制改革委员会、英国高诚证券（HK）有限公司北京代表处、法国兴业证券（HK）有限公司、康联马洪（中国）投资管理有限公司工作。2001 年 4 月起任博时公司独立董事。

姚钢先生，硕士，独立董事。1985 年起先后在中国人民大学、中国经济体制改革研究所微观研究室、中国社会科学院农村发展研究所、海南汇通国际信托投资公司、中国社会科学院经济文化研究中心工作。2001 年 4 月起任博时公司独立董事。

## 2. 基金管理人监事会成员

夏永平女士，硕士，监事。1984 年起先后在中国农业银行总行、中国长城信托投资公司、中国长城资产管理公司工作。2000 年 7 月起任博时基金管理有限公司董事。

车晓昕女士，硕士，监事。1983 年起先后在郑州航空工业管理学院、珠海证券有限公司、招商证券股份有限公司投资银行总部工作。现任招商证券股份有限公司财务部总监。

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。

窦广清先生，监事。1987 年起先后在海军后勤学院、中国银行塘沽分行工作，2006 年 12 月至今任天津港财务有限公司总经理。

卢培德先生，监事，CFA。毕业于美国加利福尼亚大学伯克莱分校 (University of California, Berkeley)，获工商管理学士学位。1995 年起先后在霸菱资产管理（香港）有限公司 (Barings)、富达投资管理公司 (Fidelity)、美林公司 (Merrill Lynch) 工作。2008 年至今，任上海盛业资产管理有限公司董事之职。

林琦先生，硕士、监事。1998 年毕业于清华大学计算机专业，获硕士学位。1998 年起先后在南天信息系统集成公司、北京万豪力霸电子科技有限公司、博时基金管理有限公司、东方基金管理有限公司工作。2006 年 8 月再次加入博时基金管理有限公司，任信息技术部副总经理。2007 年任信息技术部总经理。

## 3. 公司高管人员

杨鸷女士，简历同上。

肖风先生，简历同上。

王德英先生，硕士。1995 年起先后任北京清华计算机公司开发部经理、清华紫光股份公司 CAD 与信息事业部工作。2000 年加入博时基金管理有限公司，历任行政管理部副经理，电脑部副经理及信息技术部总经理。现任公司副总裁。

孙麒清女士，商法学硕士。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，曾任监察法律部法律顾问，现任公司督察长兼监察法律部总经理。

杨锐先生，1999 年 7 月毕业于南开大学国际经济研究所，获经济学博士学位，副总经理。1999 年 8 月加入博时基金管理有限公司，历任研究部宏观研究员、博时价值增长混合基金经理助理、研究部副总经理兼策略分析师。2005 年至 2006 年由博时公司派往纽约大学 Stern 商学院做访问学者，期间在 Allianceberstein 的股票投资部门学习。2006 年 5 月至今担任博时平衡配置混合基金经理。2007 年后曾兼任博时价值增长混合基金经理、博时价值增长贰号混合基金经理、股票投资部总经理。现任公司副总经理，兼首席策略分析师，混合组投资总监、博时平衡配置混合基金经理、博时大中华亚太精选股票

（QDII）基金经理。

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。现任公司副总经理，兼任特定资产管理部总经理、特定资产高级投资经理、社保股票基金经理。

李志惠先生，经济学博士，副总经理。1993 年 7 月起先后在深圳市住宅局房改处、深圳市委政策研究室城市研究处、深圳市委政策研究室综合处工作。2004 年 9 月加入博时基金管理有限公司，历任行政与人力资源部副总经理、总裁办公室总经理兼董事会秘书。现任公司副总经理，兼任机构业务董事总经理、董事会秘书。

李雪松先生，经济学硕士，副总经理。1988 年起先后在北京市财政局统计科、日本大和证券综合研究所、中信证券、北京玖方量子软件技术公司工作。2001 年 3 月加入博时基金管理有限公司，历任金融工程小组金融工程师、市场部南方区域销售主管、市场部南方大区总经理、北京分公司总经理。现任公司副总经理，兼任零售业务部董事总经理。

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。现任公司副总经理，兼任固定收益部总经理、社保债券基金基金经理。

#### 4. 本基金历任基金经理

芮颖女士，双硕士学历。1992年毕业于中国人民大学获货币银行学学士学位。1995年毕业于中国人民银行研究生部，获国际金融硕士学位。1998—2000 年就读于英国牛津大学，获经济学哲学硕士学位。1994年至1998年先后在中国人民银行外资金融机构管理司、中国人民银行常州分行和中国人民银行货币政策司利率处工作。2001年—2002年在香港瑞银华宝公司企业融资部兼并收购部任高级分析员。是中银香港重组上市项目（筹资金额200亿人民币）核心成员。其重点负责的中银香港信用评级顾问工作获Finance asia “年度最佳评级顾问奖”。2003年1月加入博时基金管理公司。在港工作期间获香港证券业协会（HKSI）投资顾问合格考试证书。

2006 年 7 月，芮颖女士因工作调动，不再担任博时现金收益证券投资基金基金经理。经董事会批准，本公司聘请张勇先生担任博时现金收益证券投资基金基金经理。

张勇先生，学士。2001 年毕业于南京审计学院金融学专业，获工学学士学位。2001 年至 2002 年于南京市商业银行北清支行任信贷员。2002 年至 2003 年，于南京市商业银行资金营运中心任债券交易员。2003 年 12 月，入博时基金管理有限公司，任交易部债券交易员。2006 年 7 月

起，任现金收益基金经理。

5. 投资决策委员会成员

主任委员：肖风

委员：杨锐、邵凯、董良泓、夏春、张志峰、王政、张峰

肖风先生（同上）

杨锐先生（同上）

邵凯先生（同上）

董良泓先生（同上）

夏春先生，经济学硕士。1996 年毕业于上海交通大学管理工程系。1996 年起先后在上海永道（现为普华永道）会计财务咨询公司、招商证券研发中心策略部工作。2004 年 2 月加入博时基金管理有限公司，历任研究部宏观与策略研究员、研究部副总经理，兼任策略分析师、博时平衡配置基金基金经理助理。现任研究部总经理，兼任策略分析师、博时价值增长基金、博时价值增长贰号基金基金经理。

张志峰先生，博士。1996 年 5 月起先后在摩根士丹利集团、巴克莱全球投资集团、LABRENCHÉ STRUCTUR PRODUCTS 工作。2008 年 1 月加入博时基金管理有限公司，现任股票投资部另类投资组投资总监。

王政先生，博士。1995 年毕业于美国普林斯顿大学，获得博士学位。1995 年至 1997 年在哈佛大学从事博士后研究工作。1997 年起先后在美国新泽西州道琼斯公司、美国新泽西州彭博公司研发部、美国加州巴克莱全球投资公司工作。2009 年 5 月加入博时基金管理有限公司，任股票投资部 ETF 及量化投资组投资总监、博时上证超大盘 ETF 及联接基金、博时大中华亚太股票基金（QDII）基金经理。

张峰先生，博士。1988 年起先后在 Haugen Financial System, 花旗集团 TIMCO 资产管理部、摩根士丹利投资公司、ASTEN INVESTMENT ADVISORS 工作。2010 年 2 月 22 日加入博时基金管理有限公司，现任股票投资部总经理、成长组投资总监及博时沪深 300 指数基金基金经理。

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. 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构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. 对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
4. 按照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收益；

5. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
6. 编制中期和年度基金报告；
7. 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
8. 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
9. 召集基金份额持有人大会；
10. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
11. 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者实施其他法律行为；
12. 国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### **（四） 基金管理人的承诺**

1. 基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《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，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》行为的发生；
3. 基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生；
4. 基金管理人承诺不从事其他证券法规规定禁止从事的行为。

#### **（五） 基金经理的承诺**

1. 依照有关法律、法规、规章和基金合同的规定，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谋取利益；
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；
4. 不得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) 业务部门

风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门总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。

## 四. 基金托管人

### (一) 基金托管人基本情况

#### 1、基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：胡怀邦

住所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市仙霞路18号

邮政编码：200336

注册时间：1987年3月30日

注册资本：562.59亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：张咏东

电话：021-32169999

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于2005年6月和2007年5月在香港联交所、上交所挂牌上市，是中国2010年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。根据英国《银行家》杂志公布的2009年全球1000家银行排名，交通银行总资产排名位列第56位，一级资本排名位列第49位。

交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

## 2、主要人员情况

牛锡明先生，交通银行行长，哈尔滨工业大学经济学硕士，高级经济师。2009年12月起担任交通银行副董事长、行长。

王滨先生，交通银行副行长，主管交通银行资产托管业务，南开大学经济学博士，高级经济师。曾任交通银行北京分行副行长、交通银行天津分行行长、交通银行北京分行行长。2006年1月至今任交通银行副行长、党委委员兼北京分行党委书记。

谷娜莎女士，交通银行资产托管部总经理。大学学历，经济师。曾任交通银行研究开发部主任科员、交通银行信托部代理业务处副处长、交通银行证券投资基金托管部规划处副处长、交通银行证券投资基金托管部内控巡查处处长；2001年1月任交通银行证券投资基金托管部总经理助理，2002年5月起任交通银行资产托管部副总经理，2007年12月起任交通银行资产托管部总经理。

## 3、基金托管业务经营情况

截止2010年12月末，交通银行共托管证券投资基金52只，包括博时现金收益货币、博时新兴成长股票、长城久富股票（LOF）、富国汉兴封闭、富国天益价值股票、光大保德信中小盘股票、国泰金鹰增长股票、海富通精选混合、华安安顺封闭、华安宝利配置混合、华安策略优选股票、华安创新股票、华夏蓝筹混合（LOF）、华夏债券、汇丰晋信2016周期混合、汇丰晋信龙腾股票、汇丰晋信动态策略混合、汇丰晋信平稳增利债券、汇丰晋信大盘股票、汇丰晋信低碳先锋股票、建信优势动力封闭、金鹰红利价值混合、金鹰中小盘精选混合、大摩货币、农银恒久增利债券、农银行业成长股票、农银平衡双利混合、鹏华普惠封闭、鹏华普天收益混合、鹏华普天债券、鹏华中国50混合、鹏华信用增利债券、融通行业景气混合、泰达宏利成长股票、泰达宏利风险预算混合、泰达宏利稳定股票、泰达宏利周期股票、天治创新先锋股票、天治核心成长股票（LOF）、万家公用事业行业股票（LOF）、易方达科汇灵活配置混合、易方达科瑞封闭、易方达上证50指数、易方达科讯股票、银河银富货币、银华货币、中海优质成长混合、兴全磐稳增利债券、华富中证100指数、工银瑞信双利债券、长信量化先锋股票、汇丰晋信消费红利股票。此外，还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产管理、ABS、产业基金、专户理财等12类产品，托管资产规模超过七千亿元。



## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，保证资产托管部业务规章的健全和各项规章的贯彻执行，通过对各种风险的梳理、评估、监控，有效地实现对各项业务风险的监控和管理，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

### 2、内部控制原则

- （1）全面性原则：通过各个处室自我监控和专门内控处室的风险监控的内部控制机制覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。
- （2）独立性原则：交通银行资产托管部独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金分别设置账户，独立核算，分账管理。
- （3）制衡性原则：贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织结构的设置上确保各处室和各岗位权责分明、相互牵制，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。
- （4）有效性原则：在岗位、处室和内控处室三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障内控管理的有效执行。
- （5）效益性原则：内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

### 3、内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》等法律法规，基金托管人制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理暂行办法》、《交通银行资产托管部内部控制制度》、《交通银行资产托管部项目开发管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管部保密工作制度》、《交通银行资产托管业务从业人员守则》、《交通银行资产托管部业务资料管理制度》、《交通银行资产托管部监察守则》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合理，技术系统完整独立，业务管理制度化，核心作业区实行封闭管理，有关信息披露由专人负责。

基金托管人通过基金托管业务各环节风险的事前揭示、事中控制和事后稽核的动态管理过程来实施内部风险控制，为了保障内控管理的有效执行，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行内部控制评审。

## （三）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《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，应当及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。基金托管人有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能及时纠正的，基金托管人须报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，须立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

#### （四）其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

## 五. 相关服务机构

### （一）基金管理人

名称：	博时基金管理有限公司
注册地址：	广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层
法定代表人：	杨鹤
成立日期：	1998年7月13日
批准设立机关及批准	中国证监会证监基金字【1998】26号
设立文号：	
组织形式：	有限责任公司
实收资本：	1亿元人民币
存续期间：	持续经营
客户服务中心电话：	95105568（免长途话费）
公司电话	0755-83169999
公司传真	0755-83195270

### （二）注册登记人

博时基金管理有限公司（同上）

### （三）基金托管人

公司法定中文名称：	交通银行股份有限公司（简称：交通银行）
公司法定英文名称：	BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：胡怀邦  
住所：上海市浦东新区银城中路188号  
办公地址：上海市仙霞路18号  
邮编：200336  
注册时间：1987年3月30日  
注册资本：562.59亿元  
基金托管资格批文及  
文号：中国证监会证监基字（1998）25号  
联系人：张咏东  
电话：021-32169999

#### （四） 代销机构

##### （1）中国工商银行股份有限公司

注册地址：	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址：	北京市西城区复兴门内大街 55 号
法定代表人：	姜建清
联系人：	刘业伟
传真：	010-66107914
客户服务电话：	95588
网址：	<a href="http://www.icbc.com.cn/">http://www.icbc.com.cn/</a>

##### （2）中国农业银行股份有限公司

注册地址：	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址：	北京市东城区建国门内大街 69 号
法定代表人：	项俊波
客户服务电话：	95599
网址：	<a href="http://www.abchina.com">http://www.abchina.com</a>

##### （3）中国建设银行股份有限公司

注册地址：	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址：	北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心 1 号楼
法定代表人：	郭树清
联系人：	王琳
传真：	010-66275654

客户服务电话:	95533
网址:	<a href="http://www.ccb.com/">http://www.ccb.com/</a>

**(4) 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:	胡怀邦
联系人:	曹榕
电话:	021-58781234
传真:	021-58408483
客户服务电话:	95559
网址:	<a href="http://www.bankcomm.com/">http://www.bankcomm.com/</a>

**(5) 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:	傅育宁
联系人:	邓炯鹏
电话:	0755-83198888
传真:	0755-83195049
客户服务电话:	95555
网址:	<a href="http://www.cmbchina.com/">http://www.cmbchina.com/</a>

**(6) 中信银行股份有限公司**

注册地址:	北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座
办公地址:	北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座
法定代表人:	孔丹
联系人:	丰靖
传真:	010-65550828
客户服务电话:	95558
网址:	<a href="http://bank.ecitic.com/">http://bank.ecitic.com/</a>

**(7) 上海浦东发展银行股份有限公司**

注册地址:	上海市浦东南路 500 号
办公地址:	上海市北京东路 689 号东银大厦 17 楼
法定代表人:	吉晓辉
联系人:	徐伟

电话:	021-61618888
传真:	021-63602431
客户服务电话:	95528
网址:	<a href="http://www.spdb.com.cn">http://www.spdb.com.cn</a>

**(8) 深圳发展银行股份有限公司**

注册地址:	深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦
办公地址:	深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦
法定代表人:	肖遂宁
联系人:	张青
电话:	0755-82088888
传真:	0755-25841098
客户服务电话:	95501
网址:	<a href="http://www.sdb.com.cn/">http://www.sdb.com.cn/</a>

**(9) 中国光大银行股份有限公司**

注册地址:	北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦
办公地址:	北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦
法定代表人:	唐双宁
联系人:	李伟
电话:	010-68098778
传真:	010-68560312
客户服务电话:	95595
网址:	<a href="http://www.cebbank.com">http://www.cebbank.com</a>

**(10) 中国民生银行股份有限公司**

注册地址:	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址:	北京市西城区复兴门内大街 2 号
法定代表人:	董文标
联系人:	董云巍
电话:	010-57092615
传真:	010-57092611
客户服务电话:	95568
网址:	<a href="http://www.cmbc.com.cn/">http://www.cmbc.com.cn/</a>

**(11) 北京银行股份有限公司**

注册地址:	北京市西城区金融大街甲 17 号首层
-------	--------------------

办公地址:	北京市西城区金融大街丙 17 号
法定代表人:	闫冰竹
联系人:	王曦
电话:	010-66223584
传真:	010-66226073
客户服务电话:	96169
网址:	<a href="http://www.bankofbeijing.com.cn/">http://www.bankofbeijing.com.cn/</a>

#### (12) 广东发展银行股份有限公司

注册地址:	广州市农林下路 83 号
办公地址:	广州市农林下路 83 号
法定代表人:	董建岳
联系人:	詹全鑫
电话:	020-38322542
传真:	020-87311780
客户服务电话:	4008308003
网址:	<a href="http://www.gdb.com.cn/">http://www.gdb.com.cn/</a>

#### (13) 宁波银行股份有限公司

注册地址:	宁波市江东区中山东路 294 号
办公地址:	宁波市江东区中山东路 294 号
法定代表人:	陆华裕
联系人:	胡技勋
电话:	021-63586210
传真:	021-63586215
客户服务电话:	96528（上海地区 962528）
网址:	<a href="http://www.nbcb.com.cn">http://www.nbcb.com.cn</a>

#### (14) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址:	上海市浦东新区浦东大道 981 号
办公地址:	上海市浦东新区银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15-23 层
法定代表人:	胡平西
联系人:	吴海平
电话:	021-38576666
传真:	021-50105124
客户服务电话:	021-962999

网址:	<a href="http://www.srcb.com/">http://www.srcb.com/</a>
-----	---

**(15) 徽商银行股份有限公司**

注册地址:	合肥市安庆路 79 号
办公地址:	合肥市安庆路 79 号
法定代表人:	王晓昕
联系人:	王祎
电话:	0551-2667819
传真:	0551-2667857
客户服务电话:	4008896588 (安徽省外)、96588 (安徽省内)
网址:	<a href="http://www.hsbank.com.cn">http://www.hsbank.com.cn</a>

**(16) 浙商银行股份有限公司**

注册地址:	浙江省杭州市庆春路 288 号
办公地址:	浙江省杭州市庆春路 288 号
法定代表人:	张达洋
联系人:	毛真海
电话:	0571-87659546
传真:	0571-87659188
客户服务电话:	95527
网址:	<a href="http://www.czbank.com">http://www.czbank.com</a>

**(17) 东莞银行股份有限公司**

注册地址:	东莞市城区运河东一路 193 号
办公地址:	东莞市城区运河东一路 193 号
法定代表人:	廖玉林
联系人:	胡昱
电话:	0769-22119061
传真:	0769-22117730
客户服务电话:	0769-96228
网址:	<a href="http://www.dongguanbank.cn">http://www.dongguanbank.cn</a>

**(18) 杭州银行股份有限公司**

注册地址:	杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦
办公地址:	杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦
法定代表人:	马时雍
联系人:	严峻

电话:	0571—85108195
传真:	0571—85106576
客户服务电话:	4008888508;0571-96523
网址:	<a href="http://www.hzbank.com.cn">http://www.hzbank.com.cn</a>

**(19) 南京银行股份有限公司**

注册地址:	南京市白下区淮海路 50 号
办公地址:	南京市白下区淮海路 50 号
法定代表人:	林复
联系人:	徐玲
电话:	025—84551162
传真:	025—84544129
客户服务电话:	4008896400
网址:	<a href="http://www.njcb.com.cn">http://www.njcb.com.cn</a>

**(20) 汉口银行股份有限公司**

注册地址:	武汉市江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦
办公地址:	武汉市江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦
法定代表人:	陈新民
联系人:	骆芸
电话:	027-82656224
传真:	027-82656236
客户服务电话:	027-96558;4006096558
网址:	<a href="http://www.hkbchina.com">http://www.hkbchina.com</a>

**(21) 渤海银行股份有限公司**

注册地址:	天津市河西区马场道 201-205 号
办公地址:	天津市河西区马场道 201-205 号
法定代表人:	刘宝凤
联系人:	王宏
电话:	022-58316666
传真:	022-58316569
客户服务电话:	400-888-8811
网址:	<a href="http://www.cbhb.com.cn">http://www.cbhb.com.cn</a>

**(22) 江苏张家港农村商业银行股份有限公司**

注册地址:	张家港市杨舍镇人民中路 66 号
-------	------------------



办公地址:	张家港市杨舍镇人民中路 66 号
法定代表人:	王自忠
联系人:	孙瑜
电话:	0512-58236370
传真:	0512-58236370
客户服务电话:	0512-96065
网址:	<a href="http://www.zrcbank.com">http://www.zrcbank.com</a>

### (23) 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:	曾明 宋永成
电话:	0755-25188371
传真:	0755-25188785
客户服务电话:	4001961200
网址:	<a href="http://www.961200.net">http://www.961200.net</a>

### (24) 洛阳银行股份有限公司

注册地址:	洛阳市洛阳新区开元大道与通济街交叉口
办公地址:	洛阳市洛龙区开元大道 256 号
法定代表人:	王建甫
联系人:	胡艳丽
电话:	0379-65921977
传真:	0379-65921869
客户服务电话:	0379-96699
网址:	<a href="http://www.bankofluoyang.com.cn">http://www.bankofluoyang.com.cn</a>

### (25) 烟台银行股份有限公司

注册地址:	山东省烟台市芝罘区海港路 25 号
办公地址:	山东省烟台市芝罘区海港路 25 号
法定代表人:	庄永辉
联系人:	姚华
电话:	0535-6691337
传真:	0535-6691337
客户服务电话:	4008311777
网址:	<a href="http://www.yantaibank.net">http://www.yantaibank.net</a>

**(26) 齐商银行股份有限公司**

注册地址:	淄博市张店区中心路 105 号
办公地址:	淄博市张店区中心路 105 号
法定代表人:	杲传勇
联系人:	肖斌
电话:	0533-2178888
传真:	0533-2180303
客户服务电话:	0533-96588
网址:	<a href="http://www.qsbank.cc">http://www.qsbank.cc</a>

**(27) 天相投资顾问有限公司**

注册地址:	北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座
办公地址:	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层
法定代表人:	林义相
联系人:	潘鸿
电话:	010-66045446
传真:	010-66045500
客户服务电话:	010-66045678
网址:	<a href="http://www.txsec.com">http://www.txsec.com</a>

**(28) 国泰君安证券股份有限公司**

注册地址:	上海市浦东新区商城路 618 号
办公地址:	上海市浦东新区银城中路 168 号
法定代表人:	祝幼一
联系人:	芮敏祺
电话:	021-38676666
传真:	021-38670161
客户服务电话:	95521
网址:	<a href="http://www.gtja.com/">http://www.gtja.com/</a>

**(29) 中信建投证券有限责任公司**

注册地址:	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址:	北京市朝阳区门内大街 188 号
法定代表人:	张佑君
联系人:	权唐
电话:	010-65130236

传真:	010—65182261
客户服务电话:	4008888108
网址:	<a href="http://www.csc108.com/">http://www.csc108.com/</a>

**(30) 国信证券股份有限公司**

注册地址:	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:	何如
联系人:	齐晓燕
电话:	0755—82130833
传真:	0755—82133302
客户服务电话:	95536
网址:	<a href="http://www.guosen.com.cn/">http://www.guosen.com.cn/</a>

**(31) 招商证券股份有限公司**

注册地址:	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层
办公地址:	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层
法定代表人:	宫少林
联系人:	林生迎
电话:	0755-82960223
传真:	0755—82943636
客户服务电话:	4008888111; 95565
网址:	<a href="http://www.newone.com.cn/">http://www.newone.com.cn/</a>

**(32) 广发证券股份有限公司**

注册地址:	广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼
办公地址:	广东广州天河北路大都会广场 18、19、36、37、41 和 42 楼
法定代表人:	王志伟
联系人:	黄岚
电话:	020—87555888
传真:	020—87555305
客户服务电话:	95575
网址:	<a href="http://www.gf.com.cn/">http://www.gf.com.cn/</a>

**(33) 中信证券股份有限公司**

注册地址:	深圳市深南路 7088 号招商银行大厦 A 层
办公地址:	北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦
法定代表人:	王东明
联系人:	陈忠
电话:	010-84588888
传真:	010-84865560
客户服务电话:	010-84588888
网址:	<a href="http://www.cs.ecitic.com/">http://www.cs.ecitic.com/</a>

**(34) 中国银河证券股份有限公司**

注册地址:	北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
办公地址:	北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2-6 层
法定代表人:	顾伟国
联系人:	李洋
电话:	010-66568047
传真:	010-66568536
客户服务电话:	4008888888
网址:	<a href="http://www.chinastock.com.cn/">http://www.chinastock.com.cn/</a>

**(35) 海通证券股份有限公司**

注册地址:	上海市淮海中路 98 号
办公地址:	上海市广东路 689 号海通证券大厦
法定代表人:	王开国
联系人:	金芸、李笑鸣
电话:	021-23219275
传真:	021-63602722
客户服务电话:	95553
网址:	<a href="http://www.htsec.com/">http://www.htsec.com/</a>

**(36) 华泰联合证券有限责任公司**

注册地址:	深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层(01A、02、03、04)、17A、18A、24A、25A、26A
办公地址:	深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层
法定代表人:	马昭明
联系人:	盛宗凌
电话:	0755-82492000

传真:	0755-82492962
客户服务电话:	4008888555; 95513
网址:	<a href="http://www.lhzq.com/">http://www.lhzq.com/</a>

**(37) 申银万国证券股份有限公司**

注册地址:	上海市常熟路 171 号
办公地址:	上海市常熟路 171 号
法定代表人:	丁国荣
联系人:	黄维琳、曹晔
电话:	021-54033888
传真:	021-54038844
客户服务电话:	95523
网址:	<a href="http://www.sywg.com/">http://www.sywg.com/</a>

**(38) 兴业证券股份有限公司**

注册地址:	福州市湖东路 99 号标力大厦
办公地址:	上海市浦东民生路 1199 弄五道口广场 1 号楼 21 层
法定代表人:	兰荣
联系人:	谢高得
电话:	021-38565785
传真:	021-38565783
客户服务电话:	4008888123
网址:	<a href="http://www.xyzq.com.cn/">http://www.xyzq.com.cn/</a>

**(39) 长江证券股份有限公司**

注册地址:	武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
办公地址:	武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
法定代表人:	胡运钊
联系人:	李良
电话:	027-65799999
传真:	027-85481900
客户服务电话:	95579; 4008-888-999
网址:	<a href="http://www.95579.com/">http://www.95579.com/</a>

**(40) 安信证券股份有限公司**

注册地址:	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元
-------	---------------------------------------

办公地址:	深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层
法定代表人:	牛冠兴
联系人:	陈剑虹
电话:	0755-82825551
传真:	0755-82558355
客户服务电话:	4008001001
网址:	<a href="http://www.essences.com.cn">http://www.essences.com.cn</a>

#### (41) 西南证券股份有限公司

注册地址:	重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢
办公地址:	重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢
法定代表人:	王珠林
联系人:	米兵
电话:	023-63786922
传真:	023-63810422
客户服务电话:	4008096096
网址:	<a href="http://www.swsc.com.cn">http://www.swsc.com.cn</a>

#### (42) 中信金通证券有限责任公司

注册地址:	浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座
办公地址:	浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19 层、20 层
法定代表人:	刘军
联系人:	俞会亮
电话:	0571-85776115
传真:	0571-85783771
客户服务电话:	0571-96598
网址:	<a href="http://www.96598.com.cn/">http://www.96598.com.cn/</a>

#### (43) 湘财证券有限责任公司

注册地址:	湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼
办公地址:	湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼
法定代表人:	林俊波
联系人:	钟康莺
电话:	021-68634518-8503
传真:	021-68865938
客户服务电话:	4008881551

网址:	<a href="http://www.xcsc.com/">http://www.xcsc.com/</a>
-----	---

**(44) 万联证券有限责任公司**

注册地址:	广州市中山二路 18 号广东电信广场 36—37 层
办公地址:	广州市中山二路 18 号广东电信广场 36—37 层
法定代表人:	张建军
联系人:	罗创斌
电话:	020—37865070
传真:	020—22373718—1013
客户服务电话:	4008888133
网址:	<a href="http://www.wlzq.com.cn">http://www.wlzq.com.cn</a>

**(45) 国元证券股份有限公司**

注册地址:	安徽省合肥市寿春路 179 号
办公地址:	安徽省合肥市寿春路 179 号
法定代表人:	凤良志
联系人:	李蔡
电话:	0551—2272101
传真:	0551—2272100
客户服务电话:	全国统一热线 4008888777，安徽省内热线 96888
网址:	<a href="http://www.gyzq.com.cn">http://www.gyzq.com.cn</a>

**(46) 渤海证券股份有限公司**

注册地址:	天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室
办公地址:	天津市河西区宾水道 8 号
法定代表人:	张志军
联系人:	王兆权
电话:	022—28451861
传真:	022—28451892
客户服务电话:	4006515988
网址:	<a href="http://www.bhzq.com">http://www.bhzq.com</a>

**(47) 华泰证券股份有限公司**

注册地址:	江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦
办公地址:	江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦
法定代表人:	吴万善
联系人:	李杰

电话:	025—84457777
传真:	025—84579763
客户服务电话:	95597
网址:	<a href="http://www.htsc.com.cn/">http://www.htsc.com.cn/</a>

**(48) 中信万通证券有限责任公司**

注册地址:	青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层
办公地址:	青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 20 层
法定代表人:	张智河
联系人:	吴忠超
电话:	0532-85022326
传真:	0532-85022605
客户服务电话:	0532-96577
网址:	<a href="http://www.zxwt.com.cn">http://www.zxwt.com.cn</a>

**(49) 东兴证券股份有限公司**

注册地址:	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层
办公地址:	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层
法定代表人:	崔海涛
联系人:	黄英
电话:	010-66555383
传真:	010-66555393
客户服务电话:	4008888993
网址:	<a href="http://www.dxzq.net.cn">http://www.dxzq.net.cn</a>

**(50) 东吴证券股份有限公司**

注册地址:	江苏省苏州市石路爱河桥 28 号
办公地址:	江苏省苏州市石路爱河桥 28 号
法定代表人:	吴永敏
联系人:	方晓丹
电话:	0512—65581136
传真:	0512—65588021
客户服务电话:	0512-96288
网址:	<a href="http://www.dwjq.com.cn">http://www.dwjq.com.cn</a>

**(51) 信达证券股份有限公司**

注册地址:	北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层
-------	--------------------------



办公地址:	北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层
法定代表人:	张志刚
联系人:	唐静
电话:	010-63080985
传真:	010-63080978
客户服务电话:	4008008899
网址:	<a href="http://www.cindasc.com">http://www.cindasc.com</a>

**(52) 东方证券股份有限公司**

注册地址:	上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层
办公地址:	上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层
法定代表人:	王益民
联系人:	吴宇
电话:	021-63325888-3108
传真:	021-63326173
客户服务电话:	95503
网址:	<a href="http://www.dfzq.com.cn">http://www.dfzq.com.cn</a>

**(53) 方正证券股份有限公司**

注册地址:	湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层
办公地址:	湖南长沙芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层
法定代表人:	雷杰
联系人:	彭博
电话:	0731-85832343
传真:	0731-85832214
客户服务电话:	95571
网址:	<a href="http://www.foundersec.com">http://www.foundersec.com</a>

**(54) 长城证券有限责任公司**

注册地址:	深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层
办公地址:	深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层
法定代表人:	黄耀华
联系人:	高峰
电话:	0755-83516094
传真:	0755-83516199
客户服务电话:	4006666888
网址:	<a href="http://new.cgws.com/">http://new.cgws.com/</a>

**(55) 光大证券股份有限公司**

注册地址:	上海市静安区新闻路 1508 号
办公地址:	上海市静安区新闻路 1508 号
法定代表人:	徐浩明
联系人:	刘晨
电话:	021-22169081
传真:	021-22169134
客户服务电话:	4008888788; 95525
网址:	<a href="http://www.ebscn.com/">http://www.ebscn.com/</a>

**(56) 广州证券有限责任公司**

注册地址:	广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼
办公地址:	广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼
法定代表人:	吴志明
联系人:	林洁茹
电话:	020-87322668
传真:	020-87325036
客户服务电话:	020-961303
网址:	<a href="http://www.gzs.com.cn">http://www.gzs.com.cn</a>

**(57) 南京证券有限责任公司**

注册地址:	江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号
办公地址:	江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号
法定代表人:	张华东
联系人:	徐翔
电话:	025-83364032
传真:	025-83320066
客户服务电话:	4008285888
网址:	<a href="http://www.njzq.com.cn">http://www.njzq.com.cn</a>

**(58) 大同证券经纪有限责任公司**

注册地址:	山西省大同市大北街 13 号
办公地址:	太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13
法定代表人:	董祥
联系人:	薛津
电话:	0351-4130322

传真:	0351-4192803
客户服务电话:	4007121212
网址:	<a href="http://www.dtsbc.com.cn">http://www.dtsbc.com.cn</a>

**(59) 国联证券股份有限公司**

注册地址:	无锡市县前东街 168 号
办公地址:	无锡市县前东街 168 号国联大厦 703 室
法定代表人:	范炎
联系人:	徐欣
电话:	0510-82831662
传真:	0510-82830162
客户服务电话:	4008885288 (全国), 0510-82588168 (无锡)
网址:	<a href="http://www.glsc.com.cn">http://www.glsc.com.cn</a>

**(60) 浙商证券有限责任公司**

注册地址:	杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼
办公地址:	杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼
法定代表人:	吴承根
联系人:	谢项辉
电话:	0571-87901053
传真:	0571-87901913
客户服务电话:	0571-967777
网址:	<a href="http://www.stocke.com.cn/">http://www.stocke.com.cn/</a>

**(61) 平安证券有限责任公司**

注册地址:	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼
办公地址:	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼
法定代表人:	杨宇翔
联系人:	周璐
电话:	0755-22626172
传真:	0755-82400862
客户服务电话:	4008816168
网址:	<a href="http://www.pingan.com/">http://www.pingan.com/</a>

**(62) 华安证券有限责任公司**

注册地址:	安徽省合肥市长江中路 357 号
办公地址:	安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦

法定代表人:	李工
联系人:	甘霖
电话:	0551—5161821
传真:	0551—5161672
客户服务电话:	0551-96518/4008096518
网址:	<a href="http://www.hazq.com/">http://www.hazq.com/</a>

**(63) 国海证券有限责任公司**

注册地址:	广西南宁市滨湖路 46 号
办公地址:	深圳市福田区竹子林光大银行大厦 30 楼
法定代表人:	张雅锋
联系人:	武斌
电话:	0755—83707413
传真:	0755—83700205
客户服务电话:	4008888100（全国），96100（广西）
网址:	<a href="http://www.ghzq.com.cn">http://www.ghzq.com.cn</a>

**(64) 东莞证券有限责任公司**

注册地址:	东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼
办公地址:	东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼
法定代表人:	张运勇
联系人:	梁健伟
电话:	0769-22119341
传真:	0769-22116999
客户服务电话:	0769-961130
网址:	<a href="http://www.dgzq.com.cn">http://www.dgzq.com.cn</a>

**(65) 中原证券股份有限公司**

注册地址:	郑州市经三路 15 号广汇国际贸易大厦
办公地址:	郑州市郑东新区商务外环路 10 号中原广发金融大厦 17 层
法定代表人:	石保上
联系人:	程月艳 耿铭
电话:	0371—65585670
传真:	0371—65585665
客户服务电话:	0371-967218;4008139666
网址:	<a href="http://www.ccnew.com/">http://www.ccnew.com/</a>

**(66) 中银国际证券有限责任公司**

注册地址:	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层
办公地址:	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层
法定代表人:	唐新宇
联系人:	张静
电话:	021-68604866-8309
传真:	021-50372474
客户服务电话:	4006208888; 021-61195566
网址:	<a href="http://www.bocichina.com">http://www.bocichina.com</a>

**(67) 恒泰证券股份有限公司**

注册地址:	内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号
办公地址:	内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号
法定代表人:	刘汝军
联系人:	张同亮
电话:	0471-4913998
传真:	0471-4930707
客户服务电话:	0471-4961259
网址:	<a href="http://www.cnht.com.cn/">http://www.cnht.com.cn/</a>

**(68) 国盛证券有限责任公司**

注册地址:	江西省南昌市永叔路 15 号
办公地址:	江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦
法定代表人:	管荣升
联系人:	徐美云
电话:	0791-6285337
传真:	0791-6289395
客户服务电话:	0791-96168
网址:	<a href="http://www.gsstock.com/">http://www.gsstock.com/</a>

**(69) 华西证券有限责任公司**

注册地址:	四川省成都市陕西街 239 号
办公地址:	四川省成都市陕西街 239 号
法定代表人:	杨炯阳
联系人:	金达勇
电话:	0755-83025723

传真:	0755-83025991
客户服务电话:	4008888818
网址:	<a href="http://www.hx168.com.cn">http://www.hx168.com.cn</a>

**(70) 宏源证券股份有限公司**

注册地址:	新疆乌鲁木齐建设路 2 号
办公地址:	北京市西城区太平桥大街 19 号
法定代表人:	汤世生
联系人:	李巍
电话:	010-88085338
传真:	010-88085240
客户服务电话:	4008000562
网址:	<a href="http://www.hysec.com">http://www.hysec.com</a>

**(71) 齐鲁证券有限公司**

注册地址:	山东省济南市经十路 20518 号
办公地址:	山东省济南市经七路 86 号 23 层
法定代表人:	李玮
联系人:	吴阳
电话:	0531-81283938
传真:	0531-81283900
客户服务电话:	95538
网址:	<a href="http://www.qlzq.com.cn/">http://www.qlzq.com.cn/</a>

**(72) 世纪证券有限责任公司**

注册地址:	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼
办公地址:	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼
法定代表人:	卢长才
联系人:	张婷
电话:	0755-83199511
传真:	0755-83199545
客户服务电话:	0755-83199599
网址:	<a href="http://www.csco.com.cn/">http://www.csco.com.cn/</a>

**(73) 中航证券有限公司**

注册地址:	南昌市抚河北路 291 号
办公地址:	南昌市抚河北路 291 号

法定代表人：	杜航
联系人：	余雅娜
电话：	0791-6768763
传真：	0791-6789414
客户服务电话：	400-8866-567
网址：	<a href="http://www.avicsec.com/">http://www.avicsec.com/</a>

**(74) 华林证券有限责任公司**

注册地址：	深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5、6 楼
办公地址：	深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5、6 楼
法定代表人：	段文清
联系人：	杨玲
电话：	0755-82707888
传真：	0755-82707850
客户服务电话：	4008802888 或致电各地营业部客服电话
网址：	<a href="http://www.chinalions.com/">http://www.chinalions.com/</a>

**(75) 德邦证券有限责任公司**

注册地址：	上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼
办公地址：	上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 26 楼
法定代表人：	方加春
联系人：	罗芳
电话：	021-68761616
传真：	021-68767981
客户服务电话：	4008888128
网址：	<a href="http://www.tebon.com.cn">http://www.tebon.com.cn</a>

**(76) 广发华福证券有限责任公司**

注册地址：	福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层
办公地址：	福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8、10 层
法定代表人：	黄金琳
联系人：	张腾
电话：	0591-87278701
传真：	0591-87841150
客户服务电话：	96326（福建省外请加拨 0591）
网址：	<a href="http://www.gfhfzq.com.cn">http://www.gfhfzq.com.cn</a>

**(77) 华龙证券有限责任公司**

注册地址:	甘肃省兰州市静宁路 308 号
办公地址:	甘肃省兰州市静宁路 308 号
法定代表人:	李晓安
联系人:	李昕田
电话:	0931-8888088
传真:	0931-4890515
客户服务电话:	0931-4890619 4890618 4890100
网址:	<a href="http://www.hlzqgs.com/">http://www.hlzqgs.com/</a>

**(78) 中国国际金融有限公司**

注册地址:	中国北京建国门外大街 1 号 国贸大厦 2 座 28 层
办公地址:	中国北京建国门外大街 1 号 国贸大厦 2 座 28 层
法定代表人:	李剑阁
联系人:	王雪筠
电话:	010-65051166
传真:	010-65051156
客户服务电话:	(010)85679238/85679169; (0755)83195000; (021)63861195;63861196
网址:	<a href="http://www.cicc.com.cn/">http://www.cicc.com.cn/</a>

**(79) 财通证券有限责任公司**

注册地址:	杭州市解放路 111 号
法定代表人:	沈继宁
联系人:	乔骏
电话:	0571-87925129
传真:	0571-87925100
客户服务电话:	96336 (上海地区 962336)
网址:	<a href="http://www.ctsec.com">http://www.ctsec.com</a>

**(80) 瑞银证券有限责任公司**

注册地址:	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层
办公地址:	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层
法定代表人:	刘弘
联系人:	谢亚凡
电话:	010-5922 6788



传真:	010—5922 6840
客户服务电话:	4008878827
网址:	<a href="http://www.ubssecurities.com">http://www.ubssecurities.com</a>

**(81) 中国建银投资证券有限责任公司**

注册地址:	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 20 层
办公地址:	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 20 层
法定代表人:	杨明辉
联系人:	杨瑞芳
电话:	0755-82026511
传真:	0755-82026539
客户服务电话:	4006008008
网址:	<a href="http://www.cjis.cn/">http://www.cjis.cn/</a>

**(82) 中山证券有限责任公司**

注册地址:	深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层
办公地址:	深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层
法定代表人:	吴泳良
联系人:	李珍
电话:	0755—82943755
传真:	0755—82940511
客户服务电话:	0755-82943750
网址:	<a href="http://www.zszq.com.cn">http://www.zszq.com.cn</a>

**(83) 日信证券有限责任公司**

注册地址:	呼和浩特市新城区锡林南路 18 号
办公地址:	北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层
法定代表人:	孔佑杰
联系人:	陈韦杉
电话:	010-88086830
传真:	010-66412537
客户服务电话:	010-66413306
网址:	<a href="http://www.rxzq.com.cn">http://www.rxzq.com.cn</a>

**(84) 江海证券有限公司**

注册地址:	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
办公地址:	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
法定代表人:	孙名扬
联系人:	张宇宏
电话:	0451-82336863
传真:	0451-82287211
客户服务电话:	4006662288
网址:	<a href="http://www.jhzq.com.cn">http://www.jhzq.com.cn</a>

**(85) 天源证券经纪有限公司**

注册地址:	青海省西宁市长江路 53 号汇通大厦六楼
办公地址:	深圳市民田路新华保险大厦 18 楼
法定代表人:	裴东平
联系人:	关键
电话:	0755-33331188
传真:	0755-33329815
客户服务电话:	4006543218
网址:	<a href="http://www.tyzq.com.cn">http://www.tyzq.com.cn</a>

**(86) 华宝证券有限责任公司**

注册地址:	上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 层
办公地址:	上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 层
法定代表人:	陈林
联系人:	徐方亮
电话:	021-50122222
传真:	021-50122200
客户服务电话:	4008209898; 021-38929908
网址:	<a href="http://www.cnhbstock.com">http://www.cnhbstock.com</a>

**(87) 厦门证券有限公司**

注册地址:	厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼
办公地址:	厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼
法定代表人:	傅毅辉
联系人:	卢金文
电话:	0592-5161816
传真:	0592-5161102
客户服务电话:	0592-5163588

网址:	<a href="http://www.xmzq.cn">http://www.xmzq.cn</a>
-----	---

**(88) 爱建证券有限责任公司**

注册地址:	上海市南京西路 758 号 23 楼
办公地址:	上海市南京西路 758 号 20—25 楼
法定代表人:	郭林
联系人:	陈敏
电话:	021—32229888
传真:	021—62878783
客户服务电话:	021-63340678
网址:	<a href="http://www.ajzq.com">http://www.ajzq.com</a>

**(89) 英大证券有限责任公司**

注册地址:	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址:	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人:	赵文安
联系人:	王睿
电话:	0755-83007069
传真:	0755-83007167
客户服务电话:	0755-26982993
网址:	<a href="http://www.ydsc.com.cn">http://www.ydsc.com.cn</a>

**(90) 大通证券股份有限公司**

注册地址:	辽宁省大连市中山区人民路 24 号
办公地址:	辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连期货大厦 39 层
法定代表人:	于宏民
联系人:	谢立军
电话:	0411-39673202
传真:	0411-39673219
客户服务电话:	4008169169
网址:	<a href="http://www.daton.com.cn">http://www.daton.com.cn</a>

**(五) 直销机构**

博时基金管理有限公司（同上）

### （六）律师事务所

名称：国浩律师集团（北京）事务所  
注册地址：北京市朝阳区东三环北路 38 号泰康金融大厦 9 层  
办公地址：北京市朝阳区东三环北路 38 号泰康金融大厦 9 层  
负责人：王卫东  
电话：010-65171188  
传真：021-65176800  
联系人：黄伟民  
经办律师：黄伟民、陈周

### （七）会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司  
注册地址：上海市浦东新区东昌路 568 号  
办公地址：上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼  
法定代表人：杨绍信  
电话：021-61238888  
传真：021-61238800  
联系人：陈兆欣  
经办注册会计师：汪棣、张鸿

## 六. 基金的募集与基金合同的生效

### （一）基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会证监基金字[2003]第 134 号《关于同意博时现金收益证券投资基金设立的批复》核准募集发售。募集期从 2003 年 12 月 16 日至 2004 年 1 月 14 日止，共募集 6,284,562,041.32 份基金份额，有效认购户数为 72,988 户。

### （二）基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2004 年 1 月 16 日正式生效。

## 七. 基金的申购与赎回和转换

### （一） 投资者范围

中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者（法律、法规和有关规定禁止购买者除外）、合格境外机构投资者。

### （二） 申购、赎回和转换场所

投资人可在销售人销售网点申购、赎回和转换基金份额，也可通过销售人提供的其他方式办理基金的申购、赎回和转换。

直销及代销机构的名称\住所请见本招募说明书。

### （三） 申购、赎回和转换的办理时间

投资人可于基金开放日办理基金份额的申购、赎回和转换。

1. 基金开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日。
2. 基金合同生效以后，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进行相应的调整并公告。
3. 申购、赎回和转换业务的办理时间为每交易日的 15:00 以前，15:00 以后提交的申请，按下一交易日申请处理。

### （四） 申购、赎回和转换的原则

1. 采用“确定价”原则，即申购、赎回、转换基金的份额价格以一元人民币为基准进行计算；
2. “金额申购、份额赎回和转换”原则，即申购以金额申请，赎回和转换以份额申请；
3. 投资者可在任一同时代理拟转出基金及转入目标基金销售的销售机构处办理基金转换。基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售人代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记人处注册的基金。
4. 当日的申购、赎回和转换申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销。

基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。在变更上述原则时，基金管理人必须最迟在新规则实施日前 3 个工作日在至少一种指定媒体上公告。

### （五） 申购和赎回的数额限定

1. 通过销售人购买基金单位首次购买最低金额为 500 元。追加购买金额每笔不低于 100 元。
2. 基金管理人可根据有关法律规定和市场情况，调整申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人必须最迟在调整前 3 个工作日在至少一种指定媒体上公告。

### （六） 申购、赎回和转换的程序

1. 申请方式：书面申请或销售人公布的其他方式。  
 申购、赎回和转换的确认与通知：T 日提交的有效申请，本基金注册与过户登记人在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，投资者可在 T+2 日到销售网点柜台或以销售人规定的其他方式查询申请的确认情况。投资者在办理基金业务时提交的资料信息须真实、有效。于交易日（T 日）提交的申请，投资者应在 T+2 日到销售网点柜台或销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况，投资者提交的申请经注册登记人确认（或不被确认）的后果由投资者承担。
2. 申购和赎回款项支付：基金申购采用全额缴款方式。赎回款 T+1 日从基金托管账户划出，经销售人于 T+2 日内划向投资人资金账户。
3. T 日的基金收益在当天收市后计算，并不迟于 T+1 日内公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

### （七） 申购、赎回和转换的费用

1. 本基金申购和赎回费率均为零。

基金	申购费率	赎回费率
现金收益基金	0%	0%

2. 本基金的转换费用由申购费补差和赎回费补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时的两只基金的申购费率和赎回费率的差异情况而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

### （八） 申购份额与赎回金额的计算方式

1. 基金申购份额的计算

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{基金单位面值}$$

例：某投资者用 5 万元申购本基金，则可得到  $50000 / 1.00 = 50000$  份基金单位。

2. 基金赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以面值，赎回金额单位为元，计

算结果保留到小数点后两位，第三位四舍五入。

赎回金额 = 基金单位面值 × 赎回份额

例：某投资者赎回本基金 1 万份基金单位，则其可得到赎回金额  $10000 \times 1.00 = 10000$  元。

### 3. 申购和赎回的注册登记

投资者申购成功后，基金注册登记人在 T+1 日为投资者登记权益，投资者在 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金。投资者赎回基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为投资者扣除权益。

## （九） 暂停申购与赎回的情形和处理

### 1. 暂停申购的情形和处理

出现如下情形，基金管理人可暂停接受基金投资者的申购申请。

- （1） 不可抗力；
- （2） 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；
- （3） 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，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- （4） 法律、法规、规章规定或中国证监会认定的其他情形。

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金申购，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停申购公告。在暂停申购的情况清除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

### 2. 暂停赎回的情形和处理

出现如下情形，基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请

- （1） 不可抗力；
- （2） 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；
- （3） 连续两个开放日发生巨额赎回；
- （4） 法律、法规、规章规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告，已接受的赎回申请，基金管理人应足额按时支付。

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金赎回，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停赎回公告。在暂停赎回的情况解除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

## （十） 巨额赎回的处理

指在本基金单个开放日内，基金净赎回申请份额（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）超过上一开放日本基金总份额 10% 的情形。发生巨额赎回时，基金管理人可以取消部分或全部当日已申请的基金转换业务并暂停基金转换业务。

### （1） 全额赎回

当基金管理人认为有能力全部兑付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

### （2） 部分赎回

当基金管理人认为全部兑付投资者的赎回申请有困难，或认为全部兑付投资者的赎回申请而进行的资产变现可能造成基金份额净值的较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10% 的前提下，先确定当日接受的赎回申请总份额，并按当日单个账户赎回申请量占当日赎回申请总量的比例，确定单个账户当日受理的赎回份额。未受理部分可延迟至下一个开放日办理。转入下一个开放日的赎回申请不享有优先权，以此类推，直到全部赎回为止。但投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

## （十一） 巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并延期支付时，基金管理人应在 3 个工作日内，在至少一种指定媒体上公告，通知投资者，并说明有关处理方法。

基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，并且基金管理人认为有必要决定暂停接受赎回申请时，已经接受的赎回申请可以延期支付赎回款项，但不得超过正常支付时间的 20 个工作日，并应当在指定媒体上公告。

## （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

发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应立即向中国证监会备案并应在规定期限内至少在一种指定媒体上刊登暂停公告。

1. 如果发生暂停的时间为一日，第二个工作日基金管理人应在至少一种指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告并公布最近一个开放日的基金收益。
2. 如果发生暂停的时间超过一日但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 1 个工作日在至少一种指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近 1 个开放日的基金收益。



3. 如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金收益。

## 八. 基金的非交易过户与转托管

注册登记机构受理的非交易过户只包括继承、捐赠、司法强制执行等情况下的非交易过户。继承是指基金持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠仅指基金持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的社会团体；司法强制执行指司法机构依据生效司法文书将基金持有人持有的基金份额强制判决划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。办理非交易过户必须提供相关资料。符合条件的非交易过户按《博时基金管理有限公司开放式基金业务规则》的有关规定办理。

基金份额持有人在变更办理基金赎回等交易业务办理机构时，可办理基金份额的转托管业务。转托管申请由转出销售机构发起，转出销售机构为投资者办理转出申请手续，而转入销售机构直接接收注册登记机构的份额转入确认通知。

## 九. 基金的投资

### (一) 投资目标

在保持低风险和高流动性的前提下获得高于投资基准的回报。

### (二) 投资方向

1. 到期期限在一年以内的国债、金融债、央行票据、AAA 级企业债等短期债券；
2. 债券回购；
3. 同业存款；
4. 证监会、人民银行等部门批准基金投资的商业票据及其他流动性良好的短期金融工具。

### (三) 业绩比较基准

本基金成立于 2004 年 1 月 16 日，业绩比较基准是一年期定期存款利率（税后）。

自 2009 年 7 月 1 日起，本基金的业绩比较基准变更为：活期存款利率（税后）。

如果今后市场出现更具代表性的业绩比较基准，在与基金托管人协商一致后，本基金管理人可以在报中国证监会备案后调整或变更业绩比较基准并及时公告。

#### (四)投资策略

本基金根据短期利率的变动和市场格局的变化，积极主动地在债券资产和回购资产之间进行动态地资产配置。

通过对中长期回购利率波动规律的把握对回购资产进行时间方向上的动态配置策略。同时根据回购利差进行回购品种的配置比例调整。同时，把握大盘新股发行、季节因素、日历效应等，捕捉回购利率的高点。对银行间市场和交易所市场出现的跨市场套利机会，进行跨市场套利。对于跨期限套利，进行严格的实证检验，在控制风险的基础上进行操作。在短期债券的个券选择上利用收益率利差策略、收益率曲线策略以及含权债券价值变动策略选择收益高或价值低估的短期债券，进行投资决策。

为控制风险、保证流动性，根据持有人的平均持有期限确定组合的平均持有期限。组合久期控制在 180 天以内，并通过控制同业存款的比例、保留充足的可变现资产和平均安排回购到期期限，保证基金的高流动性。

本基金的目标资产配置比例如下：

投资品种	计划配置比例
短期债券	20%—95%
债券回购	0%—75%
同业存款/现金	5%—80%

注：市场利率低于同业存款利率时，本基金可将除国债头寸以外的资金全部存放同业

##### 1. 投资决策依据

- (1) 国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定。
- (2) 宏观经济发展环境、微观企业经济运行态势和证券市场走势。

##### 2. 投资决策机制

- (1) 本基金的投资决策机制为投资决策委员会领导下的基金经理负责制。
- (2) 投资决策委员会—负责制定基金投资方面的整体战略和原则；审定基金季度资产配置和调整计划；审定基金季度投资检讨报告；决定基金禁止的投资事项等。
- (3) 基金经理—负责资产配置、个债配置、投资组合的构建和日常管理。

##### 3. 投资决策程序

- (1) 由基金经理或者组合经理对宏观经济和市场状况进行考察，进行经济与政策研究；
- (2) 数量化投资部运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对市场预期风险和投资组合风险进行风险测算，并提供分析报告；市场部每日提供基金申购赎回的数据分析报告，供基金经理决策参考；
- (3) 投资决策委员会进行资产配置政策的设计；投资决策委员会定期召开会议，依据上述报告对资产配置提出指导性意见；如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议做出决策；

- (4) 结合投资委员会和风险管理委员会的建议，基金经理或者组合经理根据市场状况进行投资组合方案设计；基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，制定资产配置、类属配置和个债配置和调整计划，进行投资组合的构建和日常管理；
- (5) 进行投资组合的敏感性分析；
- (6) 对投资方案进行合约性检查，重点检查是否满足基金合同规定和各项法律法规的规定；
- (7) 基金经理或者组合经理进行投资组合的实施，设定或者调整资产配置比例、单个券种投资比例，交易指令传达到中央交易员；交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，通过交易系统执行投资组合的买卖。交易情况及时反馈到基金经理。

#### 4. 投资组合评价

风险控制委员会根据市场变化对投资组合的资产配置和调整提出风险防范建议；风险管理小组对投资组合进行评估，并对风险隐患提出预警；监察部对投资组合的执行过程进行实时风险监控；基金经理依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险。

### (五) 投资限制

#### 1. 组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金资产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。根据中国证监会 2005 年 3 月 25 日颁布的证监基金字[2005]41 号《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》的规定，本基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%，并按有关规定履行信息披露义务；
- (2) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；
- (3) 除发生巨额赎回的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%；
- (4) 持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%；
- (5) 不得投资于以定期存款为基准利率的浮动利率债券；
- (6) 买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过 397 天；
- (7) 投资于同一公司发行的短期企业债券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (8) 可投资于信用等级为 AAA 级商业银行次级债，但该次级债的剩余期限应当在 397 天内，且投资于同一商业银行发行的次级债的比例不得超过基金资产净值的 10%；

- (9) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%，存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；
- (10) 中国证监会规定的其他比例限制。

由于基金规模或市场的变化导致的投资组合超过上述约定的比例不在限制之内。

## 2. 禁止行为

根据相关法律规定，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 投资于其他基金；
- (2) 以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- (3) 动用银行信贷资金从事证券买卖；
- (4) 将基金资产用于担保、资金拆借或者贷款；
- (5) 从事证券信用交易；
- (6) 以基金资产进行房地产投资；
- (7) 从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- (8) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人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；
- (9) 违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等行为来操纵和扰乱市场价格；
- (10) 进行高位接盘、利益输送等损害基金份额持有人利益的行为；
- (11) 证券法规规定禁止从事的其他行为。

### (六)基金管理人代表基金行使债务权利的处理原则及方法

不谋求对所投资企业的控制或者进行管理；

依照《民法通则》、《民事诉讼法》、《企业破产法》（试行）及其他法律法规的有关规定行使债权人的有关权利。

### (七)基金投资组合报告

博时基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、收益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取自本基金第四季度报告，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	固定收益投资	3,483,787,915.49	67.70
	其中：债券	3,483,787,915.49	67.70
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	210,001,035.00	4.08
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,361,765,465.55	26.46
4	其他资产	90,573,957.63	1.76
5	合计	5,146,128,373.67	100.00

### 2. 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	4.71	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	279,999,660.00	5.76
	其中：买断式回购融资	-	-

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例（%）	原因	调整期
1	2010-09-28	20.72	9 月末巨额赎回	6 个交易日

### 3. 基金投资组合平均剩余期限

#### (1) 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	140
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	153
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	109

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本基金在本报告期内不存在平均剩余期限超过 180 天的情况。

**(2) 期末投资组合平均剩余期限分布比例**

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	11.55	5.76
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	12.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.23	-
3	60 天(含)—90 天	29.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	10.19	-
4	90 天(含)—180 天	18.37	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	32.83	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	105.03	5.76

**4. 报告期末债券投资组合**
**(1) 按债券品种分类的债券投资组合**

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	321,290,222.79	6.61
3	金融债券	1,307,378,409.83	26.89
	其中：政策性金融债	1,247,380,866.96	25.66
4	企业债券	-1,309.85	0.00
5	企业短期融资券	1,855,120,592.72	38.16
6	其他	-	-
7	合计	3,483,787,915.49	71.67
8	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	555,269,064.24	11.42

注：本基金于 2010 年 12 月 31 日卖出一笔企业债，交割日为 2011 年 1 月 4 日，该债券卖出金额所含利息截止日为 2011 年 1 月 3 日，依照《证券投资基金会计核算业务指引》的相关规定，债券利息在交割日前逐日计提，因此在本报告期末应收债券利息账簿余额为负数，相应金额于 2011 年 1 月 1 日至 3 日补提。

**(2) 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细**

序	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净
---	------	------	---------	---------	--------

号					值的比例(%)
1	070211	07 国开 11	4,400,000	444,784,949.04	9.15
2	050227	05 国开 27	1,700,000	170,033,863.50	3.50
3	080406	08 农发 06	1,500,000	150,961,559.58	3.11
4	1081248	10 宁波港 CP02	1,300,000	130,010,250.30	2.67
5	010212	01 国开 12	1,000,000	101,105,982.03	2.08
6	100231	10 国开 31	1,000,000	99,974,307.18	2.06
7	100221	10 国开 21	1,000,000	99,825,826.61	2.05
8	1001019	10 央行票据 19	1,000,000	99,610,064.38	2.05
9	0801041	08 央行票据 41	900,000	90,639,240.30	1.86
10	1081384	10 云煤化 CP01	900,000	90,004,508.08	1.85

#### 5. “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项 目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25%（含）-0.5%间的次数	4 次
报告期内偏离度的最高值	0.27%
报告期内偏离度的最低值	-0.27%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.12%

#### 6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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. 投资组合报告附注

##### (1) 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持 1.00 元。

(2) 本基金在报告期内不存在持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮息债的摊余成本超过基金资产净值 20% 的情况。

(3) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

##### (4) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	49,899,985.71
3	应收利息	39,993,217.34
4	应收申购款	660,754.58
5	其他应收款	20,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	90,573,957.63

(5) 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。

## 十. 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。

期 间	①基金收益率	②基金收益率 标准差	③业绩比较基 准收益率	④业绩比较基 准收益率标准 差	①-③	②-④
2004. 1. 16-2004. 12. 31	2.2053%	0.0014%	1.5568%	0.0002%	0.6485%	0.0012%
2005. 1. 1-2005. 12. 31	2.4124%	0.0038%	1.8000%	0.0000%	0.6124%	0.0038%
2006. 1. 1-2006. 12. 31	1.9918%	0.0022%	1.8799%	0.0003%	0.1119%	0.0019%
2007. 1. 1-2007. 12. 31	2.9637%	0.0036%	2.7850%	0.0019%	0.1787%	0.0017%
2008. 1. 1-2008. 12. 31	4.2949%	0.0110%	3.7617%	0.0012%	0.5332%	0.0098%
2009. 1. 1-2009. 12. 31	1.6750%	0.0054%	1.2998%	0.0026%	0.3752%	0.0028%
2010. 1. 1-2010. 12. 31	2.1389%	0.0090%	0.3650%	0.0000%	1.7739%	0.0090%
2004. 1. 16-2010. 12. 31	19.0824%	0.0065%	13.4481%	0.0031%	5.6343%	0.0034%

重要说明：本基金采取的收益分配方式是采用 1.00 元固定份额净值交易方式，自基金成立日起每日将实现的基金净收益分配给基金份额持有人，并以份额形式按月结转到投资人基金账户，使基金账面份额净值始终保持 1.00 元。

## 十一. 基金的财产

### (一) 基金财产的构成

指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、应收债券利息以及其他资产的价值总和。



## （二） 基金资产净值

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

基金托管人代表基金，以托管人和基金联名的方式开设的证券账户、以基金名义开立的银行账户，与基金管理人、基金托管人、基金销售服务代理人、注册登记人自有资产账户以及其他基金财产账户相独立。

## （四） 基金财产的保管与处分

1. 本基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人不得将本基金财产归入其固有财产。
2. 基金管理人、基金托管人因本基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入本基金财产。
3. 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，本基金财产不属于其清算财产。
4. 非因本基金财产本身承担的债务，不得对本基金财产强制执行。

## 十二. 基金资产计价

### （一） 基金资产计价的目

基金资产的计价目的是客观、准确地反映基金资产的价值。依据经基金资产计价后确定的基金资产净值计算出基金收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持 1.00 元。

### （二） 计价日

基金成立后，每日对基金资产进行计价。

### （三） 计价对象

基金依法持有的各类有价证券。

### （四） 计价方法

1、本基金计价采用摊余成本法，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提损益。本基金的债券和票据按摊余成本计算基金资产净值。

本基金目前投资工具的计价方法：

（1）基金持有的债券、票据采用溢折价摊销后的成本列示，按票面利率计提应收利息。

- (2) 债券回购以成本列示，按协议利率在实际持有期间内逐日计提利息。
- (3) 银行存款以本金列示，按银行适用利率逐日计提利息。

2、由于按摊余成本法计价可能会出现被计价对象的其他可参考公允价值指标和摊余成本之间的偏离，为消除或减少因基金份额净值的背离导致基金份额持有人权益的稀释或其他不公平的结果，在实际操作中，基金管理人与基金托管人应定期计算投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度，并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的有效性。当投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生偏离达 0.25%时，基金管理人上报证监会；偏离达到 0.50%时，基金管理人应公告并及时报中国证监会备案并按照其它可参考公允价值指标对组合的账面价值进行调整，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值，确保以摊余成本法计算的基金资产净值不会对基金份额持有人造成实质性的损害。

3. 如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法计价。即使存在上述情况，基金管理人若采用上述 1—4 规定的方法为基金资产进行了计价，仍应被认为采用了适当的计价方法。

4. 国家有最新规定的，按其规定进行计价。

#### （五） 计价程序

基金的日常计价由基金管理人进行。基金管理人完成计价后将计价结果以书面形式报送基金托管人，基金托管人按照本基金合同规定的计价方法、时间与程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。月末、年中和年末计价复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （六） 暂停公告基金收益的情形

- (1) 基金投资涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因停市时；
- (2) 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时。

#### （七） 基金收益计算错误的确认及处理方式

差错处理的原则和方法如下：

(1) 基金收益出现错误时，基金管理人应当立即纠正，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 0.25%时，基金管理人应上报证监会，错误偏差达到基金份额净值 0.5%时，基金管理人应当公告并报国务院证券监督管理机构备案。

(3) 基金管理人和基金托管人根据有关规定进行账务处理，但计算过程有误导导致基金收益计算错误，从而给基金或基金投资人造成损失的，由基金托管人和基金管理人共同承担赔偿责任；

(4) 基金管理人具有向当事人追偿不当利得的权利。

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。

#### （八） 特殊情形的处理

基金管理人按上述计价方法进行计价时，所造成的误差不作为基金份额资产净值错误处理；由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或由于战争、火灾、地震、洪水等不可抗力原因，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计价错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

### 十三. 基金收益与分配

#### （一） 基金收益的构成

1. 基金投资所得债券利息；
2. 银行存款利息；
3. 买卖证券差价；
4. 已实现的其他合法收入；
5. 因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

#### （二） 基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定和基金合同中的有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

#### （三） 收益分配原则

1. 本基金采用 1.00 元固定份额净值交易方式，自基金成立日起每日将实现的基金净收益（或净损失）分配给基金份额持有人，并定期结转 to 投资人基金帐户，使基金账面份额净值始终保持 1.00 元。
2. 本基金收益每月集中结转一次，成立不满一个月不结转。
3. 每一基金单位享有同等分配权。
4. 本基金的分红方式是红利再投资。
5. 基金投资当期亏损时，维持基金份额净值为 1.00 元，相应采取等比例调整基金份额持有人持有份额的分配方式。
6. 在不影响投资者利益情况下，基金管理人可酌情调整基金收益分配方式，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

#### （四） 收益分配方案的确定与公告

1. 本基金于每个开放日的次日在指定报刊和管理人网站上披露开放日每万份基金净收益和 7 日年化收益率(%)。若遇法定节假日，于节假日结束后第二个自然日披露节假日期间的每万份基金净收益、节假日最后一日的 7 日年化收益率(%)，以及节假日后首个开放日的每万份基金净收益和 7 日年化收益率(%)。基金收益公告由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定。
2. 日每万份基金净收益 = 当日基金净收益 / 当日基金份额总额 × 10000;

$$\text{期间每万份基金净收益} = \sum_{w=1}^n (r_w / S_w) \times 10000;$$

其中， $r_1$  为期间首日基金净收益， $S_1$  为期间首日基金份额总额， $r_w$  为第  $w$  日基金净收益， $S_w$  为第  $w$  日基金份额总额， $r_n$  为期间最后一日基金净收益， $S_n$  为期间最后一日基金份额总额。

$$\text{按日结转份额的 7 日年化收益率} = \left\{ \left[ \prod_{i=1}^7 \left( 1 + \frac{R_i}{10000} \right) \right]^{\frac{365}{7}} - 1 \right\} \times 100\%$$

其中， $R_i$  为最近第  $i$  个自然日（包括计算当日）的每万份基金净收益。

每万份基金净收益应保留至小数点后第 4 位，7 日年化收益率保留至小数点后第 3 位。

3. 本基金每月初例行对上月实现的收益进行收益结转，具体做法是将投资人账户的当前累计收益结转为该投资人账户的本基金份额。
4. 本基金对每月例行的收益结转不再另行公告。

## 十四. 基金的费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

与基金运作有关费用包括：基金管理人的管理费；基金托管人的托管费；基金合同生效后的基金信息披露费用；基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费；基金份额持有人大会费用；基金的证券交易费用；以及其它按照国家有关规定可以在基金资产中列支的其它费用。

#### 1、基金管理人的管理费

基金管理人的管理费以基金资产净值的 0.33% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

$H$  为每日应计提的基金管理费

$E$  为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计提，按月支付，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付

日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

基金托管人的托管费按不高于前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管人的托管费每日计提，按月支付，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1、申购和赎回费

基金	申购费率	赎回费率
现金收益基金	0%	0%

### 2、转换费用

基金转换费用由转出基金赎回费和申购费补差两部分构成，其中：申购费补差具体收取情况，视每次转换时的两只基金的申购费率的差异情况而定。基金转换费用由基金持有人承担。

### 3、销售服务费

基金销售人的销售服务费按不高于前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售费

E 为前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金销售人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

4、基金管理人可按中国证监会规定程序在基金合同约定的范围内调整申购费率、赎回费率和转换费率，调整后的申购费率和赎回费率和转换费率应在实施前 3 个工作日内在至少一种指定媒体上公告。

5、管理人可以在不违背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，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等定期或不定期地开展基金促销活动。

### （三）其他费用

1、其它与基金运作有关费用根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

2、基金管理费、托管费和销售服务费的调整

基金管理人、基金托管人和销售人可以协商调低基金管理费、基金托管费和销售服务费，前述费率下调无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

3、基金费用种类的调整

本基金可在中国证监会允许的条件下按照国家的有关规定增加其他种类的基金费用。如本基金仅对新发行的基金单位适用新的基金费用种类，不涉及现有基金份额持有人利益的，无须召开基金份额持有人大会。

### （四）基金税收

根据财政部财税[2004]78 号《国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的要求，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

本基金运作过程中的各类纳税主体，依照国家法律、法规的规定，履行纳税义务。

## 十五. 基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

1. 基金的会计年度为公历每年 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：如果基金成立少于 3 个月，可以并入下一个会计年度；
2. 基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
3. 会计制度执行国家有关的会计制度；
4. 基金独立建账、独立核算；
5. 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；
6. 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；
7. 基金的会计责任人为基金管理人，基金管理人也可以委托基金托管人或者具有证券从业资格的独立的会计师事务所担任基金会计，但担任基金会计责任人的会计师事务所不能同时从事本基金的审计业务。

## （二） 基金审计

1. 基金管理人聘请具有证券从业资格的会计师事务所及其具有证券从业资格的注册会计师对基金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，须事先征得基金管理人和基金托管人同意；

基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所须在 5 个工作日内公告。

## 十六. 基金的信息披露

基金的信息披露应符合《信息披露办法》及其实施准则、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》、基金合同及其他有关规定。本基金的信息披露通过中国证券报、上海证券报、证券时报以及本公司网站（www.bosera.com）进行公告。

### （一） 招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金招募说明书自基金合同生效日起，每 6 个月更新一次，并于每 6 个月结束之日后的 45 日内公告，更新内容截至每 6 个月的最后 1 日。

基金管理人按照《证券投资基金信息披露管理办法》及其实施准则《证券投资基金招募说明书的内容与格式》、基金合同编制并公告招募说明书。

### （二） 基金合同

基金合同是约定基金管理人、基金托管人、基金份额持有人权利、义务的法律文件。

### （三） 基金托管协议

基金托管协议是约定基金管理人和基金托管人权利、义务的法律文件。

### （四） 年度报告、中期报告、季度报告、基金收益公告

1. 基金年度报告经注册会计师审计后在基金会计年度结束后的 90 日内公告。
2. 基金中期报告在基金会计年度前 6 个月结束后的 60 日内公告。
3. 基金季度报告每季度一次，于每季度结束后的 15 个工作日内公告。
4. 基金合同生效后，本基金每个开放日的次日披露开放日每万份基金净收益和 7 日年化收益率（%）。若遇法定节假日，于节假日结束后第二个自然日披露节假日期间的每万份基金净收益、节假日最后一日的 7 日年化收益率（%），以及节假日后首个开放日的每万份基金净收益和 7 日年化收益率（%）。
5. 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日收益和基金七日收益率（%）。基金管理人应当在上述规定的市场交易日的次日，将基

金日收益和基金七日收益率（%）等信息登载在指定报刊和网站上。

### （五） 临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益产生重大影响的事件时，将按照法律法规及中国证监会的有关规定及时向中国证监会报告并公告：

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 50%；
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 30%；
11. 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
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 0.5%；
18. 基金改聘会计师事务所；
19. 变更基金份额发售机构；
20. 基金更换注册登记机构；
21. 基金开始办理申购、赎回；
22. 基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
23. 基金发生巨额赎回并延期支付；
24. 基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
25. 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。

### （六） 澄清公告

在基金合同期限内，公共媒体中出现或市场上流传的消息可能对基金收益产生误导性影响或引起较大的波动的，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。



### （七）信息披露文件的存放与查阅

本基金合同、招募说明书、年度报告、中期报告及其摘要、基金收益公告和基金投资组合公告等文本文件将存放于基金管理人、基金托管人和销售代理人的办公场所，投资者可在办公时间查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制或复印件。对投资者按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管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(www.bosera.com)的网站查阅和下载上述文件。

## 十七. 风险揭示

相比其它基金产品，虽然本基金风险较低，但投资人仍有可能承担一定的风险。包括：

### 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）信用风险

金融债和企业债的发行人不能按期还本付息和回购交易中交易对手在回购到期交割责任时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成本基金的信用风险。

#### （2）利率风险

中央银行的利率调整和市场利率的波动构成本基金的利率风险。由于利率波动，基金投资人会面临投资现金收益基金的收益率没有存款利率高的风险。

#### （3）再投资风险

债券偿付本息后以及回购到期后可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率，由此本基金面临再投资风险。

#### （4）通货膨胀风险

如果中国今后出现物价水平持续上涨，通货膨胀率提高，现金收益基金的投资价值会因此降低。

#### （5）政策风险

国家政策发生不利于基金投资人的变化，构成本基金的政策风险。另外，如果国家对同业存款利率下调，会使基金的现金投资收益减少，也是本基金的政策风险。

#### （6）策略风险

本基金投资策略不同于股票基金和债券基金，对流动性要求较高，这种确保高流动性的投资策略有可能造成投资收益的减少。

### 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公司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：是指公司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、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。

## 十八、基金合同的终止与清算

### （一）基金合同的终止

出现下列情况之一的，基金合同终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；
2. 基金管理人职责终止，而在六个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；
3. 基金托管人职责终止，而六个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；
4. 基金合同规定的其他情况或中国证监会允许的其它情况。

### （二）基金财产清算小组

1. 自基金合同终止日起 30 个工作日内成立清算小组，清算小组必须在中国证监会的监督下进行基金清算。
2. 基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、由基金管理人选定的律师事务所、具有从事证券相关业务资格的注册会计师事务所以及中国证监会指定的人员组成。基金管理人、基金托管人以及上述会计师事务所和律师

事务所应在基金合同终止之日起 15 个工作日内将本方参加清算小组的具体人员名单函告其他各方。基金清算小组可以聘请必要的工作人员。

3. 基金清算小组接管基金资产后，负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

### (三)清算程序

1. 基金合同终止后，发布基金清算公告；
2. 基金清算小组统一接管基金资产；
3. 对基金资产进行清理和确认；
4. 对基金资产进行估价；
5. 对基金资产进行变现；
6. 将基金清算结果报告中国证监会；
7. 以自身名义参加与基金有关的民事诉讼；
8. 公布基金清算结果公告；
9. 进行基金剩余资产的分配。

### (四)清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组优先从基金资产中支付。

### (五)基金资产按下列顺序清偿

1. 支付清算费用；
2. 交纳所欠税款；
3. 清偿基金债务；
4. 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金资产按前款 1-4 项规定依顺序清偿，在上一顺序权利人未得以清偿前，不分配给下一顺序权利人。

### (六)基金清算的公告

基金清算公告于基金终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内公告；清算过程中的有关重大事项将及时公告；基金清算结果公告由基金清算小组经中国证监会批准后在 3 个工作日内公告。

### (七)基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 十九. 基金合同内容摘要

### (一)基金管理人的权利和义务

1. 基金管理人的权利
  - (1) 自基金成立之日起，依法并依照基金合同的规定独立运用并管理基金资产；
  - (2) 依照基金合同获得基金管理费及其他约定和法定的收入；

- (3) 依据基金合同及有关法律的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同或国家有关法律的规定，致使基金资产或基金份额持有人利益产生重大损失的，应呈报中国证监会和中国人民银行，必要时应采取保护措施保护基金投资者的利益；
- (4) 销售基金单位；
- (5) 提议召开基金份额持有人大会；
- (6) 代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；
- (7) 担任注册登记人或委托其他机构担任注册登记人或更换注册登记人；
- (8) 委托和更换销售服务代理人，并对其销售服务代理行为进行监督；
- (9) 在基金合同规定的情形出现时，决定暂停受理基金单位的申购、暂停受理基金单位的赎回；
- (10) 决定基金收益的分配方案；
- (11) 根据基金合同的规定提名新的基金管理人和基金托管人；
- (12) 组建或参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (13) 有关法律、法规、规章和基金合同规定的其他权利。

## 2. 基金管理人的义务

- (1) 遵守基金合同，以诚实信用、勤勉尽责的原则依法管理并运用基金的全部资产；
- (2) 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资产；
- (3) 配备足够的专业人员办理开放式基金的注册登记业务或委托其他机构办理该业务；
- (4) 配备足够的专业人员办理基金单位的认购、申购、赎回和其他业务或委托其他机构代理该项业务；
- (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，确保所管理的基金资产和基金管理人的自有资产相互独立，确保所管理的不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；
- (6) 除法律、法规、规章和基金合同另有规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得转托第三人运作基金资产；
- (7) 接受基金托管人的依法监督；
- (8) 按规定计算并公告基金资产净值及基金收益；
- (9) 依法履行与基金有关的信息披露及报告义务；
- (10) 保守基金商业秘密，除法律、法规、规章及基金合同另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (11) 按规定向基金份额持有人分配基金收益；

- (12) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回、分红款项；
- (13) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- (14) 按有关规定制作相关账册，保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上；
- (15) 依照基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会；
- (16) 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定的时间内发出；并保证投资人能够按照基金合同规定的时间和方式，查阅到与基金有关公开资料并得到有关资料的复印件；
- (17) 参加基金清算小组，参加基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (19) 因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；
- (20) 基金托管人因过错造成基金资产损失时，应为基金向基金托管人追偿；
- (21) 有关法律、法规、规章和基金合同规定的其他义务。

## **(二) 基金托管人的权利与义务**

### **1、基金托管人的权利**

- (1) 依法持有并保管基金资产；
- (2) 获取基金托管费；
- (3) 监督本基金的投资运作；
- (4) 监督基金管理人，如认为基金管理人违反基金合同或有关法律法规的规定，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；
- (5) 在更换基金管理人时，提名新任基金管理人；
- (6) 法律法规及基金合同规定的其他权利。

### **2、基金托管人的义务**

- (1) 遵守基金契约；
- (2) 以诚实信用、勤勉尽责的原则依法安全保管基金的全部资产；
- (3) 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、合格的熟悉基金托管业务专职人员，从事基金资产托管事宜；
- (4) 基金托管人应当代表基金，以托管人和基金联名的方式开设证券账户、以基金名义开立银行账户等基金资产账户，严格执行基金管理人的投资指令，认真办理基金投资的证券的清算交割及基金名下的资金往来；
- (5) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国人民银行和中国

证监会；

(6) 计算并与基金管理人核对基金资产净值或基金单位收益及相应的收益率；

(7) 按有关规定制作相关账册，保存基金的会计账册、报表和记录 15 年以上；

(8) 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，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基金资产相互独立；对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；

(9) 除法律、法规、规章及基金契约另有规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得转托第三人托管基金资产；

(10) 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；

(11) 建立并保存基金持有人名册；

(12) 保守基金商业秘密，除法律、法规、规章及本契约另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

(13) 采用适当、合理的措施，使基金单位的认购、申购、赎回等事项符合基金契约等有关法律文件的规定；

(14) 采用适当、合理的措施，使基金管理人用以处理基金单位的认购、申购和赎回业务的方法符合基金契约等有关法律文件的规定；

(15) 采用适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合基金契约等有关法律文件的规定；

(16) 在基金定期报告内出具基金托管人意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金契约的规定进行；如果基金管理人未执行基金契约规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(17) 依据基金管理人的指令或有关规定，将基金持有人的基金收益和赎回款项支付到专用账户；

(18) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国人民银行并通知基金管理人；

(20) 因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

(21) 基金管理人因过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；

(22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

(23) 有关法律、法规、规章和基金契约规定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人的权利和义务

## 1、基金份额持有人的权利

- (1) 按照基金契约的规定提议召开或自行召开及出席或者委派代表出席基金持有人大会，并行使表决权；
- (2) 取得基金收益；
- (3) 监督基金运作情况；
- (4) 按照基金契约的规定查询或者获取公开的基金业务和基金财务状况资料；
- (5) 按照基金契约的规定申购、赎回或转让基金单位；
- (6) 参与基金清算后剩余资产的分配；
- (7) 要求基金管理人或基金托管人履行基金契约规定的义务；
- (8) 因基金管理人、基金托管人、注册登记机构、销售机构的过错导致利益受到损害，有权要求赔偿；
- (9) 法律、法规、规章和基金契约规定的其他权利。

## 2、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守基金合同；
- (2) 按照规定支付相应费用；
- (3) 在持有的基金单位范围内，承担基金亏损或者终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及基金其他当事人利益的活动；
- (5) 返还持有基金过程中获得的不当得利；
- (6) 法律、法规、规章和基金合同规定的其他义务。

## （四）基金份额持有人大会

### 1. 基金份额持有人大会的组成

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。

### 2. 召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人或基金托管人或持有 10%以上（含 10%）基金单位的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 修改基金合同，但基金合同另有约定的除外；
- (2) 终止基金合同；
- (3) 基金管理人的更换；
- (4) 基金托管人的更换；
- (5) 提高基金管理费或托管费的收费比例。但根据届时有效的有关法律、法规提高；
- (6) 与其他基金合并；
- (7) 转换基金类型；
- (8) 法律、法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

### 3. 召集方式

- (1) 基金份额持有人大会由基金管理人在其发出或收到基金合同第五（二）条所述提议之日起 60 日内召集，开会的具体时间、地点、方式、权益登记日由基金管理人决定。
- (2) 如基金管理人在前款规定期限内未行使召集权，基金托管人有权在前款规定期限届满之日起 60 日内召集基金份额持有人大会，基金管理人应予以配合。
- (3) 如基金管理人和基金托管人均未在规定期限内行使召集权，提议召开基金份额持有人大会的基金份额持有人有权在前款所述期限届满之日起 60 日内自行召集基金份额持有人大会，基金管理人及基金托管人应予以配合。如果提议召开基金份额持有人大会的基金份额持有人未在本款规定期限内召集基金份额持有人大会，应视为其已经撤销了召开该大会的提议。

### 4. 通知

召开基金份额持有人大会，召集人最迟应于会议召开前 20 日通知基金份额持有人。通知方式可以为在至少一种指定媒体上公告和召集人认为合适的其他方式。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 有权出席会议的基金份额持有人权益登记日；
- (4) 授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达的期限、地点；
- (5) 投票表决截止时间（一般适用通讯开会情况）；
- (6) 会务联系人姓名、电话及其他联系方式；
- (7) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (8) 召集人需要通知的其他事项。

### 5. 召开方式

- (1) 会议方式
  - a. 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会；
  - b. 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；
  - c. 通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决；
  - d. 会议的召开方式由召集人确定。但决定基金管理人更换或基金托管人的更换事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

- (2) 基金份额持有人大会召开条件

- a. 现场开会

必须同时符合以下条件时，现场会议方可举行：



- i. 到会的人数不少于 10 人；
- ii. 亲自出席会议的基金份额持有人或代理人所代表的基金份额持有人合计不少于 50 人；
- iii. 会议召开时间后 30 分钟内，对到会者在权益登记日持有基金单位的统计显示，有效的基金份额不低于代表权益登记日基金总份额的 25%；
- iv. 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金单位的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金单位的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律、法规和规章、基金合同及会议通知的规定，并且持有基金单位的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

未能达到上述条件，但同时符合以下条件时，也可以进行基金份额持有人大会：

- i. 到会人数不少于 7 人，其中持有 50 万份以下基金单位的基金份额持有人或代理人不少于 3 人；
- ii. 会议召开时间后 30 分钟内，对到会者在权益登记日持有基金单位的统计显示，有效的基金份额不低于代表权益登记日基金总份额的 30%；
- iii. 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金单位的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金单位的凭证及委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和规章、基金合同的规定。

未能满足上述（a）的条件，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间（至少应在 15 个工作日后）和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。重新以现场开会方式再次召集基金份额持有人大会的，必须同时符合以下条件：

- i. 到会人数不少于 5 人；
- ii. 亲自出席会议者持有基金单位的凭证、代理人出具的委托人持有基金单位的凭证及授权委托书均符合法律、法规、基金合同和会议通知的规定；
- iii. 会议召开时间后 30 分钟内，对到会者在权益登记日持有基金单位的统计显示，有效的基金份额不低于代表权益登记日基金总份额的 20%。

**b. 通讯方式开会**

必须同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

- i. 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不少于 50 人，代表权益登记日基金份额 25%以上(含 25%)的基金份额持有人或其代理人在表决截止日前(含当日)以书面方式进行表决（以收到书面表决材料的日期为准）。或者基金份额持有人少于 50 人，而其所出具有效书面意见所代表的基金份额持有人所持有的基金份额不少于在权益登记日基金总份额的 30%。对于通讯开会方式的表决，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律、法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为无效表决。代理人在通讯方式开会中进行表决时，应向召集人同时提交有关基金份额持有人出具的有效的授权委托书；
- ii. 参加表决的基金份额持有人身份证明及持有基金单位的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金单位的凭证及授权委托书代理手续完备并符合有关法律、法规和规章、基金合同及会议通知的规定，并且持有基金单位的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；
- iii. 召集人在基金托管人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；
- iv. 会议通知公布前报中国证监会备案。

如表决截止日前(含当日)未达到上述要求,则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在 15 个工作日后），但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。重新以通讯开会方式再次召集基金份额持有人大会的，必须同时符合以下条件：

- i. 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不少于 25 人，并且所有出具有效书面意见所代表的基金份额持有人所持有的基金份额不少于在权益登记日基金总份额的 20%；或者基金份额持有人少于 25 人，并且所有出具有效书面意见所代表的基金份额持有人所持有的基金份额不少于在权益登记日基金总份额的 25%；
  - ii. 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金单位的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金单位的凭证及委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律、法规和规章、基金合同的规定；
  - iii. 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；
  - iv. 召集人在基金托管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；
  - v. 会议通知公布前已报中国证监会备案。
6. 议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

议事内容仅限于基金合同本条第（二）款所述事由。

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。

基金管理人、基金托管人、持有权益登记日基金总份额 10%或以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案，也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案最迟应当在大会召开日前 15 日提交召集人；召集人对于临时提案应当最迟在大会召开日前 10 日公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 10 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 10 日的间隔期。

## （2） 议事程序

### a. 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经具有证券从业律师资格的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50%以上多数（不含 50%）选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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）、身份证号码、住所地址、持有或者代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

### b. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人在会议通知中提前 20 日公布提案，在所通知的表决截止日期第二日统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## 7. 表决

- （1） 基金份额持有人所持每份基金单位享有一票表决权。
- （2） 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

一般决议，一般决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的 50%以上（不含 50%）通过方为有效；除下列（2）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。

特别决议，特别决议须经代表权益登记日基金总份额的 50%以上（不含 50%）的持有人或代理人通过方可作出。涉及基金管理人更换、基金托管人更换、基金终止等重大事项以及有关重大事项的契约修改必须以特别决议的方式通过方为有效。

- （3） 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
- （4） 对于通讯开会方式的表决，除非在计票时有充分的相反证据证明，否

则表面符合法律、法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为无效表决。

- (5) 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。

## 8. 计票

### (1) 现场开会

- a. 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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，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三名代表担任监票人。
- b. 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。
- c. 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或者代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，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的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 9. 生效与公告

- (1) 基金份额持有人大会决议自作出之日起生效，但其中需中国证监会或其他有权机构批准的，自批准之日或相关批准另行确定的日期起生效。
- (2) 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人均有法律约束力。
- (3) 基金份额持有人大会决议自生效之日起 5 个工作日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

## 10. 争议的解决

对于因本协议的订立、内容、履行和解释或与本协议有关的争议，本基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会深圳分会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

### （五） 基金合同的效力

1. 基金契约经基金发起人、基金管理人和基金托管人盖章以及法定代表人或授权代表签字并经中国证监会批准后生效。基金契约的有效期限自生效之日至该基金清算结果报中国证监会批准并公告之日。
2. 基金契约自生效之日对基金契约当事人具有法律约束力。
3. 基金契约正本一式十份，基金发起人、基金管理人和基金托管人各持有两份，其余报送中国证监会和中国人民银行各两份，每份具有同等的法律效力。
4. 基金契约可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售服务代理人及注册登记人办公场所查阅；投资者也可按工本费购买基金契约复制件或复印件，但应以基金契约正本为准。

### （六） 基金合同的终止

出现下列情况之一的，基金合同经中国证监会批准后将终止：

1. 存续期间内，基金持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人将宣布本基金终止；
2. 基金持有人大会表决终止的；
3. 因重大违法行为，基金被中国证监会责令终止的；
4. 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，而无其他适当的基金管理公司承受其原有权利及义务；
5. 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，而无其他适当的托管机构承受其原有权利及义务；
6. 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
7. 按照基金合同规定的程序未能在 60 日内产生新的基金管理人；
8. 中国证监会允许的其它情形。

### （七） 基金合同的终止日

基金终止后，应当依照有关法律法规和基金合同的规定对基金进行清算。基金合同于中国证监会批准基金清算结果并予以公告之日终止。

## 二十. 托管协议内容摘要

### （一） 托管协议当事人

#### 1、基金管理人

基金管理人： 博时基金管理有限公司

注册地址： 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

办公地址： 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： 杨驊  
成立时间： 1998 年 7 月 13 日  
批准设立机关： 中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）  
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： 1 亿元人民币  
经营范围： 发起设立基金、基金管理  
存续期间： 持续经营

a) 基金托管人

基金托管人： 交通银行股份有限公司  
住所： 上海市浦东新区银城中路 188 号  
法定代表人： 胡怀邦

注册时间： 1987 年 3 月 30 日

基金托管业务批准文号： 证监基字【1998】25 号

经营范围： 吸收人民币存款；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；从事同业拆借；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；自营外汇买卖；代理外汇买卖；代理国外信用卡的发行和付款；资信调查、咨询、见证业务；基金托管业务；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： 489.94 亿元

存续期间： 持续经营

## （二） 基金托管人与基金管理人之间的业务监督与核查

### 1. 基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

- (1) 基金托管人根据《基金法》、基金合同及其他有关规定，对基金的投资范围、基金资产的投资比例、基金资产净值的计算、基金托管人与基金管理人资金划拨、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。对基金管理人因以上方面的过错导致基金资产灭失、减损或处于危险状态等，基金托管人应立即以书面方式要求基金管理人予以纠正和采取必要的补救措施。

- (2) 基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》、基金合同及其他有关规定，有权以书面形式通知基金管理人限期纠正，并报告中国证监会，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函。在限期内，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。
- (3) 基金托管人发现基金管理人具有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

## 2. 基金管理人对于基金托管人的业务监督、核查

- (1) 根据《基金法》、基金合同及其它有关规定，基金管理人对基金托管人是否执行以下职能进行监督：及时执行基金管理人的投资指令、妥善保管基金的全部资产、按时将赎回资金和分配给基金份额持有人的收益划入专用账户、对基金资产实行分账管理、不得擅自用基金资产等。当基金托管人因上述过错导致基金资产灭失、减损或处于危险状态时，基金管理人应立即以书面方式要求基金托管人予以纠正和采取必要的补救措施。
- (2) 基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、基金合同及其他有关规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函。在限期内，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。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。
- (3) 基金管理人发现基金托管人具有重大违规行为，应立即报告中国证监会，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。

## 3. 基金托管人与基金管理人在业务监督、核查中的配合、协助

基金托管人与基金管理人具有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本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，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

### （三）基金资产保管

#### 1. 基金资产保管的原则

- (1) 基金托管人依法持有并安全保管基金的全部资产。
- (2) 基金资产应独立于基金管理人、基金托管人的所有或管理的其他资产。基金托管人应当为基金设立独立账户，本基金资产与基金托管人的其它资产或其它业务以及其它基金的资产应当实行严格的分账管理。
- (3) 基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

## 2. 基金成立时募集资金的验证

基金募集期满，由基金管理人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。验资报告应由参加验资的 2 名以上中国注册会计师签字有效。

基金管理人应将属于基金资产的全部资金划入基金托管人以基金名义开立的银行账户中，验资报告出具后，基金成立。

若基金未达到规定的募集额度则基金不能成立。在此情况下，基金管理人和基金托管人应当按照基金合同的有关规定办理退款事宜。

## 3. 投资人申购资金和赎回资金的收付管理

基金托管人负责及时查收申购资金是否到达基金账户，对于未准时到账的资金，要立即通知基金管理人，核实资金划拨情况；对于赎回资金，基金托管人应在收到注册登记人发送的完整的清算数据和基金管理人发送的划款指令后及时进行支付。

基金连续两个开放日以上发生巨额赎回的，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延期支付赎回款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在中国证监会指定媒体上公告。在延期支付时间内基金托管人应按基金管理人的指令进行支付。

## 4. 基金的银行账户的开设和管理

- (1) 基金的银行账户的开设和管理由基金托管人负责。
- (2) 基金托管人以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用并承担相应的责任。基金的一切货币收支活动，均须通过基金的银行账户进行。
- (3) 基金的银行账户的开立和使用，限于满足开展基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的账户进行基金业务以外的活动。
- (4) 基金的银行账户的管理应符合中国人民银行的有关规定。

## 5. 基金证券账户的开设和管理

基金托管人根据中国证监会和中国证券登记结算有限责任公司的有关规定，以托管人和基金联名形式代理基金开立证券账户。以托管人自身名义为所有托管的基金开立清算备付金账户。由托管人为所托管的各个基金分别进行二级清算，并向基金管理人提供基金二级清算账户资金余额对账单。

基金证券账户的开立和运用，限于满足开展基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和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基金业务以外的活动。

根据业务发展需要，经双方协商同意，基金托管人还可根据有关规定开立其他投资品种的账户。



#### 6. 基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人以基金名义存放于基金托管人的保管库、中央国债登记结算公司、中国证券登记结算公司或其他有权办理存管业务的机构的保管库中；保管凭证由基金托管人保存。实物证券的购买和转让由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

#### 7. 和基金资产有关的重大合同的保管

合同原件由基金托管人保管，保管期限 15 年以上。

### （四）基金资产计价、基金资产净值计算与复核

#### 1、基金资产计价

##### （1）计价对象

基金依法拥有的债券等有价证券。

##### （2）计价方法

- a. 本基金计价采用摊余成本法，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。本基金的债券和票据按摊余成本计算基金资产净值；
- b. 基金持有的债券、票据采用溢折价摊销后的成本列示，按票面利率计提应收利息；
- c. 债券回购以成本列示，按协议利率在实际持有期间内逐日计提利息；
- d. 银行存款以本金列示，按银行适用利率逐日计提利息；
- e. 由于按摊余成本法计价可能会出现被计价对象的其他可参考公允价值指标和摊余成本之间的偏离，为消除或减少因基金份额净值的背离导致基金持有人权益的稀释或其他不公平的结果，在实际操作中，基金管理人与基金托管人应定期计算投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度，并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的有效性。当投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生偏离达到 0.25% 时，基金管理人上报证监会；偏离达到 0.50% 时，基金管理人应公告并及时报中国证监会备案并按照其它可参考公允价值指标对组合的账面价值进行调整，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值，确保以摊余成本法计算的基金资产净值不会对基金持有人造成实质性的损害；
- f. 如按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法计价。即使存在上述情况，基金管理人若采用上述（1）—（5）规定的方法为基金资产进行了计价，仍应被认为采用了适当的计价方法；
- g. 国家有最新规定的，按其规定进行计价。

##### （3）计价程序

基金的日常计价由基金管理人进行。基金管理人完成计价后将计价结果以书面形式报送基金托管人，基金托管人按照本基金合同规定的计价方法、时间与程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。月末、年中

和年末计价复核与基金会计账目的核对同时进行。

（4） 暂停公告基金收益的情形

- a. 基金投资涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因停市时；
- b. 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时。

（5） 基金收益的确认及错误的处理方式

差错处理的原则和方法如下：

- a. 基金收益出现错误时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；
- b. 错误偏差达到基金份额净值 0.25% 时，基金管理人应上报证监会，错误偏差达到基金份额净值 0.5% 时，基金管理人应当公告并报国务院证券监督管理机构备案；
- c. 基金管理人和基金托管人根据有关规定进行账务处理，但计算过程有误导致基金收益计算错误，从而给基金或基金投资人造成损失的，由基金托管人和基金管理人共同承担赔偿责任；
- d. 基金管理人具有向当事人追偿不当利得的权利。

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。

（6） 特殊情形的处理

基金管理人按上述计价方法进行计价时，所造成的误差不作为基金份额资产净值错误处理；由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或由于战争、火灾、地震、洪水等不可抗力原因，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计价错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 2、基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

### （1） 基金资产净值的计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的余额。

每个工作日计算基金资产净值及基金万份收益和七日年化收益率，并按规定公告。

### （2） 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行计价后，将基金资产净值、基金万份收益和七日年化收益率发送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的计价方法、时间、程序进行复核；经基金托管人复核无误后，签章并以加密传真方式发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

## 3、基金会计制度

按国家有关的会计制度执行。

#### 4、基金账册的建立和基金账册的定期核对

##### （1） 基金账册的建立

基金会计核算由基金管理人承担，基金托管人按双方约定的同一记账方法和会计处理原则，独立地设置、记录和保管本基金的全套账册，用于对基金会计的复核。双方应指定经办基金的财务会计人员负责编制、保管基金的会计账册；双方管理或托管的不同基金的会计账册，应完全分开，分别编制和保管。

##### （2） 凭证保管及核对

证券交易凭证由基金托管人和基金管理人分别保管并据此建账。

基金管理人按日编制基金估值表，与基金托管人核对，从而核对证券交易账目。

基金托管人办理基金的资金收付、证券实物出入库所获得的凭证，由基金托管人保管原件并记账，每月附指令回执和单据复印件交基金管理人核实。

基金托管人与基金管理人对基金账册每月核对一次。经对账发现双方的账目存在不符的，基金托管人与基金管理人应及时查明原因并纠正，保持双方的账册记录完全相符。

#### 5、基金财务报表与报告的编制和复核

基金财务报表由基金托管人与基金管理人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月结束后 5 个工作日内完成；基金投资组合公告在截止日后 15 个工作日内公告；招募说明书在本基金成立后每六个月公告一次，于截止日后 45 日内公告。中期报告在基金会计年度前六个月结束后 60 日内公告；年度报告在基金会计年度结束后 90 日内公告。

基金管理人应在报告内容截止日后的 3 个工作日内完成月度报表编制，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人应在 2 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人应在中期报告内容截止日后 30 日内完成报告的编制，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 20 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人应在年度报告内容截止日后 50 日内完成报告的编制，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金托管人与基金管理人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，双方各留存一份。

基金托管人在对中期报告或年度报告复核完毕后，需出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

若因特殊原因上述报告的制作和复核需提前完成时，托管人应予以配合。

##### （五） 基金份额持有人名册的登记与保管

注册登记人负责编制和保管基金份额持有人名册。

基金托管人和基金管理人对基金份额持有人名册的保管，按国家法律法规及证券监督管理部门的要求执行。

#### （六） 争议的解决

1. 因本协议产生的争议，双方当事人应通过协商途径解决。协商不成的，任何一方均可将该争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，按照申请仲裁时该会现行有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对双方均有拘束力。
2. 争议处理期间，双方当事人应恪守职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。
3. 在争议解决期间，除争议所涉部分外，本协议其余部分应继续履行。

#### （七） 托管协议的修改和终止

1. 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。修改后的新协议，报中国证监会批准后生效。
2. 发生以下情况，本托管协议终止：
  - （1） 基金或《基金合同》终止；
  - （2） 因基金托管人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金托管人；
  - （3） 因基金管理人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金管理人；
  - （4） 发生《基金法》或其他法律法规规定的终止事项。

### 二十一. 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供如下服务，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。

#### （一） 持有人交易资料的寄送服务

每次交易结束后，投资者可在T+2个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单；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对账单。

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。

投资者可以登录博时公司网站 [www.bosera.com](http://www.bosera.com) “博时快e通”系统网上自助订阅；或发送“订阅电子对账单”邮件到客服邮箱 [service@bosera.com](mailto:service@bosera.com)；也可直接拨打全国统一客服热线 95105568（免长途话费）订阅。

## （二） 红利再投资

本基金的分红方式为红利再投资，红利再投资免收申购费用。本基金不接受投资者的变更分红方式申请。

## （三） 定期定额投资

本基金可通过销售机构为投资者提供定期定额投资的服务，即投资者可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购基金份额。

## （四） 基金转换

投资者可在同时销售转出基金、转入基金并开办基金转换业务的销售机构办理基金转换业务(由于转出基金和转入基金须为统一注册登记机构，目前不支持主题行业基金与其它基金间的转换业务)。基金转换需遵守本公司关于基金转换的业务规则，具体业务规则详见本公司发布在指定信息披露媒体及本公司网站上的公告。

## （五） 网上交易

有关基金网上交易的具体业务规则请登录本公司网站(<http://www.bosera.com>)查询。

## （六） 资讯服务

### 1. 手机短信服务

投资者在申请开立本公司基金账户或变更帐户资料时如预留有效的手机号码，可获得手机短信公共信息服务、交易确认通知；或投资者可以发送短信到指定号码查询基金份额净值、基金账户份额等信息。

### 2. 电子邮件服务

投资者在申请开立本公司基金账户或变更帐户资料时如预留有效的电子邮件，可获得邮件公共信息服务，如《博时资讯》周刊、分红公告通知等信息。

投资者也可以自己在本公司网站订阅每日基金份额净值、各只基金的公开信息等内容。

## （七） 客户服务中心

### 1. 语音自助服务

客户服务中心自动语音系统提供每周 7 天、每天 24 小时的自动语音服务和查询服务，客户可通过电话查询最新的基金份额净值、基金交易和持有信息等内容，与博时公司签订远程服务协议直销客户还可以通过电话进行基金的认购、申购、赎回等交易。

## 2. 人工坐席服务

客户服务中心提供每周 7 日、每日 8 小时的人工坐席服务（不含国庆及春节假期）。

客户服务电话：95105568（免长途话费）

传真：010-65187032

## 3. 信邮服务

客户可以通过平信、电子邮件、网站留言三种方式和本公司联系，客户服务中心会有专人对客户的信邮进行回复。

### （八） 帐户资料变更

为了便于客户及时得到博时提供的各项服务，请客户及时更新联系信息。客户可通过以下三种方式进行联系信息（包括地址、电话、EMAIL 等）的变更：

- 通过销售机构进行帐户资料变更业务申请；
- 通过本公司客户服务中心的人工坐席服务；
- 通过本公司网站网上交易与查询系统（网址：[www.bosera.com](http://www.bosera.com)）自助修改联系信息。

### （九） 客户投诉和建议处理

投资者可以通过基金管理人提供的网上留言、客户服务中心自动语音留言、客户服务中心人工坐席、平信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。

## 二十二. 其它应披露的事项

- （一）2010 年 7 月 20 日，我公司公告了《博时现金收益证券投资基金 2010 年第 2 季度报告》；
- （二）2010 年 8 月 3 日，我公司公告了《关于方正证券有限责任公司增加代销博时基金管理有限公司旗下开放式基金的公告》；
- （三）2010 年 8 月 17 日，我公司公告了《关于德邦证券有限责任公司增加代销博时基金管理有限公司旗下开放式基金的公告》；
- （四）2010 年 8 月 19 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司增加日信证券有限责任公司为代销机构的公告》；
- （五）2010 年 8 月 24 日，我公司公告了《博时现金收益证券投资基金 2010 年半年度报告（摘要）》、《博时基金管理有限公司增加渤海银行股份有限公司为代销机构的公告》；
- （六）2010 年 8 月 25 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司郑州分公司成立的公告》；
- （七）2010 年 9 月 3 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司增加东兴证券股份有限公司为代销机构的公告》；

- （八） 2010 年 9 月 10 日，我公司公告了《关于博时现金收益证券投资基金 2010 年“中秋”及“国庆”长假前暂停申购及转换转入业务的公告》；
- （九） 2010 年 10 月 13 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于博时现金收益证券投资基金恢复大额申购及转换转入业务的公告》；
- （十） 2010 年 10 月 26 日，我公司公告了《博时现金收益证券投资基金 2010 年第 3 季度报告》；
- （十一） 2010 年 11 月 8 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司增加齐商银行股份有限公司为代销机构的公告》；
- （十二） 2010 年 11 月 9 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司增加烟台银行股份有限公司为代销机构的公告》、《博时基金管理有限公司关于设立博时基金（国际）有限公司的公告》；
- （十三） 2010 年 11 月 11 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司沈阳分公司成立的公告》；
- （十四） 2010 年 12 月 9 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司增加洛阳银行股份有限公司为代销机构公告》；
- （十五） 2010 年 12 月 13 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于开通汇付天天盈直销网上交易和费率优惠的公告》；
- （十六） 2010 年 12 月 20 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司增加深圳农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告》；
- （十七） 2010 年 12 月 27 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于博时现金收益证券投资基金 2011 年“元旦”假期前暂停申购及转换转入业务的公告》。

### 二十三. 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记机构的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金招募说明书复制件或复印件，但应以基金招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

### 二十四. 备查文件

中国证监会批准博时现金收益证券投资基金设立的文件

《博时现金收益证券投资基金基金合同》

《博时现金收益证券投资基金托管协议》

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

基金托管人业务资格批件、营业执照

关于博时基金管理有限公司募集设立博时现金收益证券投资基金之法律意见书

**博时基金管理有限公司**

**2011 年 3 月 2 日**