

博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘

要

【重要提示】

1、本基金根据 2015 年 12 月 28 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015] 3087 号）进行募集。

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和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

3、投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额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，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

4、本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

在本基金封闭期内，基金份额持有人只能通过证券市场二级市场交易卖出基金份额变现。在证券市场持续下跌、基金二级市场交易不活跃等情形下，有可能出现基金份额二级市场交易价格低于基金份额净值的情形，即基金折价交易，从而影响基金份额持有人收益或产生损失。

在本基金封闭期内，本基金以参与投资定向增发股票为主要投资目标，公募基金参与定向增发，如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，将按照监管机构或行业协会有关规定确定股票公允价值，本基金基金净值可能由于估值方法的原因偏离所持有股票的收盘价所对应的净值，投资者在二级市场交易或受限申购赎回时，需考虑该估值方式对基金净值的影响。

本基金可投资于中小企业私募债，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

5、本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，但低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的产品。

6、本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

7、在封闭期，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-100%，其中定向增发（非公开发行）股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；转为上市开放式基金（LOF）后，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%，其中以事件驱动策略投资的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。债券等固定收益类证券投资比例为基金资产的 0%-100%。权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%。

8、本基金初始募集面值为人民币 1.00 元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于初始面值，本基金投资者有可能出现亏损。

9、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也不构成对本基金业绩表现的保证。

10、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。

11、本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2016 年 11 月 30 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

第一部分 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二十七个直属部门，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、多元资产管理部、年金投资部、产品规划部、营销服务部、客户服务中心、市场部、养老金业务中心、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。养老金业务中心负责公司社保基金、企业

年金、基本养老金及职业年金的客户拓展、销售与服务、养老金研究与政策咨询、养老金销售支持与中台运作协调、相关信息服务等工作。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工作。特定资产管理部负责公司权益类特定资产专户和权益类社保投资组合的投资管理及相关工作。多元资产管理部负责公司的基金中基金投资产品的研究和投资管理工作。年金投资部负责公司所管理企业年金等养老金资产的投资管理及相关工作。产品规划部负责新产品设计、新产品报批、主管部门沟通维护、产品维护以及年金方案设计等工作。互联网金融部负责公司互联网金融战略规划的设计和实施，公司互联网金融的平台建设、业务拓展和客户运营，推动公司相关业务在互联网平台的整合与创新。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 9 月 30 日，公司总人数为 488 人，其中研究员和基金经理超过 88%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管理有限公司，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、运作、指数与量化投资等工作，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、博时资本管理有限公司董事。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。

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、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，现任公司副总经理兼博时资本管理有限公司董事。

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

陈鹏扬先生，金融学硕士。2008年至2012年在中国国际金融有限公司，担任A/H股汽车行业分析师，历任经理、高级经理、副总经理。2012年7月加入博时基金管理有限公司，负责零售、新能源、汽车、机械、安防等行业研究，历任研究员、资深研究员、投资经理。现任博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金（2015年8月24日起至今）、博时睿远定增灵活配置混合型证券投资基金（2016年4月15日起至今）、博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金（2016年5月31日起至今）、博时弘盈定期开放混合型证券投资基金（2016年8月1日起至今）、博时睿益定增灵活配置混合型证券投资基金（2016年8月19日起至今）、博时弘裕18个月定期开放债券型证券投资基金（2016年8月30日起至今）、博时弘泰定期开放混合基金（2016年12月9日起至今）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、过钧、白仲光
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、博时精选混合基金、博时新趋势混合基金的基金经理。

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，历任投资经理、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。现任首席宏观策略分析师兼宏观策略部总经理、多元资产管理部总经理。

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、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。现任研究部总经理兼博时主题行业混合（LOF）基金、博时沪港深优质企业混合基金、博时沪港深成长

企业混合基金的基金经理。

过钧先生，硕士，CFA。1995年起先后在上海工艺品进出口公司、德国德累斯顿银行上海分行、美国Lowes食品有限公司、美国通用电气公司、华夏基金固定收益部工作。2005年加入博时基金管理有限公司，历任基金经理、博时稳定价值债券投资基金的基金经理、固定收益部副总经理、博时转债增强债券型证券投资基金、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金、博时裕祥分级债券型证券投资基金、博时双债增强债券型证券投资基金、博时新财富混合型证券投资基金的基金经理。现任董事总经理兼固定收益总部公募基金组投资总监、博时信用债券投资基金、博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）、博时新收益灵活配置混合型证券投资基金、博时新机遇混合型证券投资基金、博时新价值灵活配置混合型证券投资基金、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金、博时鑫源灵活配置混合型证券投资基金、博时乐臻定期开放混合型证券投资基金、博时新起点灵活配置混合型证券投资基金、博时双债增强债券型证券投资基金的基金经理。

白仲光先生，博士。1991年起先后在石家庄无线电九厂、石家庄经济学院、长盛基金、德邦基金、上海金珀资产管理公司工作。2015年加入博时基金管理有限公司，现任年金投资部投资总监兼股票投资部绝对收益组投资总监。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人情况

名称：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

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

二、主要人员情况

截至2016年9月末，中国工商银行资产托管部共有员工210人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

三、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2016 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 624 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 51 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

四、托管业务的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014 年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2015 年中国工商银行资产托管部第九次通过 ISAE3402（原 SAS70）审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内部控制制度的检查、评价部门必须独立于内部控制制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资

产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

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《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、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监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。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。基金管理人对于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限期纠正。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、场外销售机构

(1) 直销机构

博时基金管理有限公司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

联系人：尚继源

博时一线通：95105568（免长途话费）

(2) 其他场外代销机构

(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：杨菲

传真：010—66107914

客户服务电话：95588

网址：<http://www.icbc.com.cn/>

(2) 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>

(3) 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：北京市西城区太平桥大街 25 号光大中心

法定代表人：唐双宁

联系人：朱红

电话：010—63636153

传真：010—63636157

客户服务电话：95595

网址：<http://www.cebbank.com>

(4) 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：洪崎

联系人：王继伟

电话：010—58560666

传真：010—57092611

客户服务电话：95568

网址：<http://www.cmbc.com.cn/>

(5) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

联系人：陈春林

传真：010—68858117

客户服务电话：95580

网址：<http://www.psbc.com>

(6) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：范一飞

联系人：汤征程

电话：021-68475521

传真： 021-68476497

客户服务电话： 95594

网址： <http://www.bankofshanghai.com>

(7) 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>

(8) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址： 上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

办公地址： 上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼

法定代表人： 冀光恒

联系人： 施传荣

电话： 021-38576666

传真： 021-50105124

客户服务电话： 021-962999;4006962999

网址： <http://www.srcb.com/>

(9) 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>

(10)江苏银行股份有限公司

注册地址： 南京市洪武北路 55 号
办公地址： 南京市中华路 26 号
法定代表人： 夏平
联系人： 田春慧
电话： 025-58587018
传真： 025-58587038
客户服务电话： 95319
网址： <http://www.jsbchina.cn>

(11)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/>

(12)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>

(13)厦门银行股份有限公司

注册地址： 厦门湖滨北路 101 号厦门银行大厦

办公地址： 厦门湖滨北路 101 号厦门银行大厦

法定代表人： 吴世群

联系人： 方伟强

电话： 0592-2270333

传真： 0592-5061952

客户服务电话： 4008588888

网址： <http://www.xmccb.com/>

(14)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址： 深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址： 北京市西城区金融大街 35 号国企大厦 C 座 9 层

法定代表人： 杨懿

联系人： 张燕

电话： 010-58325388

传真： 010-58325300

客户服务电话： 400-166-1188

网址： <http://8.jrj.com.cn/>

(15)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>

(16)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>

(17)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

(18) 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： 400-181-8188

网址： <http://www.1234567.com.cn>

(19) 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>

(20) 蚂蚁（杭州）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>

(21) 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>

(22) 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： 浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼
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： 400-877-3772
网址： www.5ifund.com

(23) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室
办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼
法定代表人：沈继伟
联系人：徐鹏
电话：021-50583533
传真：021-50583633
客户服务电话：400-067-6266
网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

(24)北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A
办公地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A
法定代表人：梁蓉
联系人：田磊
电话：010-66154828
传真：010-88067526
客户服务电话：010-88067525
网址：www.5irich.com

(25)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>

(26) 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：400-786-8868

网址：<http://www.chtfund.com>

(27) 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

(28) 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

(29)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

(30)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

(31)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

(32) 中信建投期货有限公司

注册地址： 重庆市渝中区中山三路 107 号上站大楼平街 11-B，名义层 11-A，8-B4，9-B、C
办公地址： 重庆市渝中区中山三路 107 号皇冠大厦 11 楼
法定代表人： 彭文德
联系人： 刘芸
电话： 023-89769637
传真： 023-86769629
客户服务电话： 400-8877-780
网址： www.cfc108.com

(33) 中信期货有限公司

注册地址： 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层
办公地址： 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层
法定代表人： 张皓
联系人： 韩钰
电话： 010-60833754
传真： 010-57762999
客户服务电话： 400-990-8826
网址： www.citicsf.com

(34) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址： 中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址： 上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人： 杨德红

联系人： 芮敏祺

电话： 021—38676666

传真： 021—38670161

客户服务电话： 95521

网址： www.gtja.com

(35) 中信建投证券股份有限公司

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： 王常青

联系人： 权唐

电话： 010—85130588

传真： 010—65182261

客户服务电话： 4008888108

网址： <http://www.csc108.com/>

(36) 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： 周杨

电话： 0755—82130833

传真： 0755—82133952

客户服务电话： 95536

网址： <http://www.guosen.com.cn/>

(37) 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： <http://www.cs.ecitic.com/>

(38) 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： 李笑鸣

电话： 4008888001

传真： 021—63602722

客户服务电话： 95553

网址： <http://www.htsec.com/>

(39) 申万宏源证券有限公司

注册地址： 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址： 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人： 李梅

联系人： 李玉婷

电话： 021-33389888

传真： 021-33388224

客户服务电话： 95523 或 4008895523

网址： www.swhysc.com

(40) 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： <http://www.xyzq.com.cn/>

(41) 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： <http://www.95579.com/>

(42) 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：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

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：<http://www.essences.com.cn>

(43) 湘财证券股份有限公司

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：<http://www.xcsc.com/>

(44) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

网址：<http://www.citicssd.com>

(45) 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：徐勇力

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555246

客户服务电话：4008888993

网址：<http://www.dxzq.net>

(46) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

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：95321

网址：<http://www.cindasc.com>

(47) 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：郭军瑞

电话：0731-85832503

传真：0731-85832214

客户服务电话： 95571

网址： <http://www.foundersec.com>

(48) 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 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： 0755-83515567

客户服务电话： 4006666888

网址： <http://www.cgws.com>

(49) 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： 薛峰

联系人： 刘晨

电话： 021-22169081

传真： 021-22169134

客户服务电话： 4008888788；95525

网址： <http://www.ebscn.com/>

(50) 广州证券股份有限公司

注册地址： 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址： 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人： 邱三发

联系人： 林洁茹
电话： 020—88836999
传真： 020—88836654
客户服务电话： 020-961303
网址： <http://www.gzs.com.cn>

(51) 上海证券有限责任公司
注册地址： 上海市西藏中路 336 号
办公地址： 上海市西藏中路 336 号
法定代表人： 龚德雄
联系人： 张瑾
电话： 021-53519888
传真： 021-63608830
客户服务电话： 4008918918、021-962518
网址： www.962518.com

(52) 大同证券有限责任公司
注册地址： 大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层
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： <http://www.dtsbc.com.cn>

(53) 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： 江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702 室

法定代表人： 范炎

联系人： 沈刚

电话： 0510—82831662

传真： 0510—82830162

客户服务电话： 4008885288（全国），0510-82588168（无锡）

网址： <http://www.glsc.com.cn>

(54) 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： 郑舒丽

电话： 0755—22626172

传真： 0755—82400862

客户服务电话： 4008816168

网址： <http://www.pingan.com/>

(55) 华安证券股份有限公司

注册地址： 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址： 安徽省合肥市南二环 959 号财智中心 B1 座

法定代表人： 李工

联系人： 甘霖

电话： 0551—65161821

传真： 0551—65161672

客户服务电话： 0551-96518/4008096518

网址： <http://www.hazq.com/>

(56) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

联系人：王一彦

电话：021-20333333

传真：021-50498825

客户服务电话：95531；400888588

网址：<http://www.longone.com.cn>

(57) 华西证券股份有限公司

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：张曼

电话：010-68716150

传真：028-86150040

客户服务电话：4008888818

网址：<http://www.hx168.com.cn>

(58) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦
20 楼 2005 室

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：李季

联系人：唐岚

电话：010-88085201

传真： 010—88085195
客户服务电话： 4008000562
网址： <http://www.hysec.com>

(59) 中泰证券有限公司

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： <http://www.qlzq.com.cn/>

(60) 第一创业证券股份有限公司

注册地址： 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼
办公地址： 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼
法定代表人： 刘学民
联系人： 吴军
电话： 0755-23838751
传真： 0755-25838701
客户服务电话： 95358
网址： www.firstcapital.com.cn

(61) 中国国际金融股份有限公司

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： <http://www.cicc.com.cn/>

(62) 华鑫证券有限责任公司

注册地址： 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

办公地址： 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

法定代表人： 洪家新

联系人： 陈敏

电话： 021-64316642

传真： 021-64333051

客户服务电话： 021-32109999, 029-68918888

网址： <http://www.cfsc.com.cn>

(63) 中国中投证券有限责任公司

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-

21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、
23 单元

办公地址： 深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人： 龙增来

联系人： 刘毅

电话： 0755-82023442

传真： 0755-82026539

客户服务电话： 4006008008

网址： <http://www.cjis.cn/>

(64) 中山证券有限责任公司

注册地址： 深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

办公地址： 深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

法定代表人： 黄扬录

联系人： 罗艺琳

电话： 0755-82570586

客户服务电话： 4001022011

网址： <http://www.zszq.com.cn>

(65) 国金证券股份有限公司

注册地址： 四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址： 四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人： 冉云

联系人： 刘婧漪、贾鹏

电话： 028-86690057、028-86690058

传真： 028-86690126

客户服务电话： 4006-600109

网址： <http://www.gjzq.com.cn>

(66) 中国民族证券有限责任公司

注册地址： 北京西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座

办公地址： 北京西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 613

法定代表人： 赵大建

联系人： 李微

电话： 010-59355941

传真： 010-66553791

客户服务电话： 400-889-5618

网址： <http://www.e5618.com>

(67) 华宝证券有限责任公司

注册地址： 上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

办公地址： 上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

法定代表人： 陈林

联系人： 刘闻川

电话： 021-68777222

传真： 021-68777822

客户服务电话： 4008209898;021-38929908

网址： <http://www.cnhbstock.com>

(68) 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： 上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人： 钱华

联系人： 戴莉丽

电话： 021-32229888

传真： 021-68728703

客户服务电话： 021-63340678

网址： <http://www.ajzq.com>

(69) 天风证券股份有限公司

注册地址： 湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

法定代表人： 余磊

客户服务电话： 400-800-5000

网址： www.tfzq.com

(70) 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

2、场内销售机构

本基金场内销售机构为深圳证券交易所内具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所认可的会员单位发售，具体名单详见本基金基金份额发售公告或相关业务公告。

3、基金管理人可根据有关法律法规，变更、增减发售本基金的销售机构，并及时公告。

二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系电话：（010）59378888

传真：（010）59378907

联系人：朱立元

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：（021）23238800

联系人：张振波

经办注册会计师：薛竞、张振波

第四部分 基金的名称

博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金

第五部分 基金的类型

契约型开放式

第六部分 基金的投资目标

在封闭期内，本基金主要投资于定向增发的证券，基金管理人在严格控制风险的前提下，通过对定向增发证券投资价值的深入分析，力争基金资产的长期稳定增值。转为上市开放式基金（LOF）后，本基金主要在对公司股票投资价值的长期跟踪和深入分析的基础上，挖掘和把握国内经济结构调整和升级的大背景下的事件性投资机会，力争基金资产的长期稳定增值。

第七部分 投资的方向

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币

市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。

在封闭期,本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-100%,其中定向增发(非公开发行)股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;转为上市开放式基金(LOF)后,本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%,其中以事件驱动策略投资的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。债券等固定收益类证券投资比例为基金资产的 0%-100%。权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%。

第八部分 投资策略

(一) 本类别资产配置策略

本基金将按照风险收益配比原则,实行动态的资产配置。

本基金将综合考量宏观经济变量(包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及国家财政、税收、货币、汇率各项政策,来动态调整大类资产的配置比例。

(二) 股票投资策略

(1) 定增参与策略

在本基金的封闭期,基金管理人将主要采取一级市场参与定向增发策略:

1) 精选策略:以价值投资理念和方法分析拟参与定增项目的内在价值。首先,采用竞争优势和价值链分析方法,对企业所在的产业结构与发展、企业的竞争策略和措施、募投项目的质量、募投项目是否与公司发展具有协同效应等进行深入调研;其次,用财务和运营等相关数据如投资回报率(ROIC)、税息折旧及摊销前利润(EBITDA)等表征主营业务健康状况的系列指标进行企业盈利能力和发展前景的评估。

2) 成本策略:在价值精选的基础上,严格执行成本控制和安全边际法则。通过内在价值比较和市场相对价值比较确定安全边际。对于内在价值相较于市场相对价值具有一定的差距时,相应地,本基金在参与此定增项目时将要求较高的折价比例。

3) 配置策略:以价值分析方法指导组合内各定增项目的资产配置比例。组合的构建从单个项目选取出发,不事先做特定行业筛选。本组合采取一定措施管理组合行业集中度风险,单一行业所占组合资产净值的比例不超过 30%。

4) 价值跟踪策略：基金管理人将密切跟踪投资项目的基本面情况，动态评估企业投资价值，及时调整未来售出时的目标价。

5) 售出策略：对于解除锁定的增发股份，基金管理人将基于市场环境、公司估值水平\同类行业估值水平、公司近期的经营管理状况等作出是否售出的判断。

项目退出策略更注重本金和盈利的安全。

基于以上定向增发策略，结合当前政策的变化，基金管理人采取相对灵活的参与方法获取超额收益。

(2) 事件驱动策略

本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，主要采用事件驱动的投资策略。包括

1) 定增事件驱动策略

基金管理人通过“自上而下”和“自下而上”相结合的投资思路和定性分析与定量分析相佐证的分析方法,立足于上市公司的定增行为对上市公司估值重构、盈利提升的影响、上市公司市值管理需要、市场情绪特征、宏观经济环境等多方面的因素综合判断，把握定增事件的二级市场联动效应，审慎制定参与二级市场投资交易的投资方案。

定向增发项目自预案公告开始至成功实施历经董事会、股东大会、发审委、证监会等几个环节的审议批准。基金管理人基于对定增事项的成功性判断，结合二级市场投资者认同度，重点关注自股东大会公告至发审委审批通过阶段投资机遇。

基金管理人定向增发概念股票的筛选兼顾公司基本面分析以及定增项目前景及收益分析。就基本面分析而言，通过分析上市公司所处行业、主营业务、同行业竞争水平、公司内部管理水平、盈利能力、资本负债结构、商誉等，评估上市公司的“内在价值”。就定向增发项目而言，基金管理人将侧重于定增方案是否与公司现有业务具有协同效应，是否有助于提升公司核心竞争力和成长性，是否具有有良好的业务增长空间等，并对定增项目的风险因素做充分的评估。从以上定增项目的选择标准出发，基金管理人拟（1）重点关注资产重组、资产收购类以及大股东参与的增发项目；（2）规避周期性行业在景气高位的扩产增发项目；

（3）设定溢价率（二级市场交易价格相比与增发预案底价）以及“预案公告至股东大会公告”期间涨幅率量化指标；精选具有潜在定向增发效应提振的个股。

2) 股东增持与回购事件驱动

股份增持包括股东增持和高管增持，其中股东增持是指公司股东及其一致行动人增持股份行为；高管增持是指公司高管及其一致行动人增持股份的行为；股份回购是指公司按一定的程序购回发行或流通在外的本公司股份的行为。公司股权的变动不仅仅直接改变公司的资产结构，同时也会对企业未来在生产、经营、管理

等多个方面产生影响。本基金通过定性和定量方法对股权变动可能带来的影响进行模拟分析，挑选具有绝对或相对估值吸引力的公司股票，再通过分析和评估股权变化，结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

3) 超预期业绩预告事件驱动

超预期业绩预告事件是指公司披露的实际业绩显著超越过去3个月券商等研究机构的预测平均数的情况。此两种情况都显示公司经营上出现显著变化，本基金将通过筛选与分析业绩变化情况，自下而上评估，结合公司基本面情况，择优选取成长性好，安全边际高的公司进行投资。

4) 资产重组，包括重组、注入与并购事件

资产重组是企业与其他主体对企业资产的分布状态进行重新组合、调整、配置的过程，或对设在企业资产上的权利进行重新配置的过程。重组前后公司的估值往往会有明显的改变。

本基金在市场上收集公开的事件信息，对事件影响中的公司进行分析与估值，挑选具有吸引力的公司股票。

5) 高分红及高转送事件

分红指公司以现金分红方式将盈余公积和当期应付利润的部分或全部发放给股东，是股东分享公司红利的重要方式，高分红是指公司分红比例较高的股票。高转送是实施较高比例的送股或者转股的股票。

本基金将通过筛选、分析和评估高分红，高转送股票；结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

6) 股权激励事件

股权激励包括员工持股、股票期权等不同形式，使企业经营者与所有者利益一致，利润与风险共担；起到改善公司治理，提升公司运营效率的作用。

本基金将对采用股权激励的公司进行调研，综合分析公司基本面、预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

7) 其他影响公司的重大事件

其他事件包括但不限于公司发布对预期业绩及行业造成极大影响的重要产品或重大合同公告；有影响上下游公司的重大事项发生；公司遭遇重大危机；管理层发生重大变更等。此类事件会对公司的运营造成深远的影响，继而影响其市场估值。

本基金将通过筛选、分析和评估发生重大变动的股票，结合其预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资

（三）股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

（四）债券投资策略

根据流动性管理、资产配置等需要，本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益类证券的投资。债券投资策略包括利率策略、信用策略、久期策略等，由相关领域的专业研究人员提出独立的投资策略建议，经固定收益投资团队讨论，并经投资决策委员会批准后形成固定收益证券指导性投资策略。

（五）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。

（六）资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益

（七）中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征，选择风险与收益相匹配的品种进行投资。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%。

沪深 300 指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两市指数，该指数编制合理、透明，有一定的市场覆盖、抗操纵性强，并且有较高的知名度和市场影响力。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，能够较好的反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。综合考虑到本基金大类资产的配置情况和指数的代表性，本基金选择沪深 300 指数和中债综合指数的平均加权作为本基金的投资业绩比较基准。

随着市场环境的变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金时，本基金管理人可

以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整，而无需召开基金份额持有人大会。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上刊登公告。

第十部分、基金的风险收益特征

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金品种。

第十一部分、基金的投资组合报告

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 336,033,413.32 49.90

其中：股票 336,033,413.32 49.90

2 固定收益投资 --

其中：债券 --

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 200,000,000.00 29.70

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 45,949,709.50 6.82

7 其他各项资产 91,422,090.21 13.58

8 合计 673,405,213.03 100.00

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

代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 --

B 采矿业 --

C 制造业 225,153,429.72 33.49

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 6,263,748.26 0.93

E 建筑业 10,017,354.70 1.49

F 批发和零售业 57,034,937.89 8.48

G 交通运输、仓储和邮政业 13,668,222.75 2.03

H 住宿和餐饮业	--
I 信息传输、软件和信息技术服务业	6,870,682.40 1.02
J 金融业	--
K 房地产业	--
L 租赁和商务服务业	17,025,037.60 2.53
M 科学研究和技术服务业	--
N 水利、环境和公共设施管理业	--
O 居民服务、修理和其他服务业	--
P 教育	--
Q 卫生和社会工作	--
R 文化、体育和娱乐业	--
S 综合	--
合计	336,033,413.32 49.98

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

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1	300274	阳光电源	5,453,143	63,747,241.67	9.48
2	002223	鱼跃医疗	1,011,749	32,082,560.79	4.77
3	600335	国机汽车	1,747,088	21,209,648.32	3.15
4	002541	鸿路钢构	1,332,445	20,466,355.20	3.04
5	002528	英飞拓	2,949,852	20,353,978.80	3.03
6	002583	海能达	1,801,802	20,252,254.48	3.01
7	603939	益丰药房	610,000	19,544,400.00	2.91
8	300373	扬杰科技	902,913	18,211,755.21	2.71
9	300317	珈伟股份	634,921	17,619,057.75	2.62
10	002400	省广股份	1,251,841	17,025,037.60	2.53

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 11.92

2 应收证券清算款 91,357,054.54

3 应收股利 -

4 应收利息 26,397.90

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 38,625.85

8 其他 -

9 合计 91,422,090.21

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

流通受限情况说明

1 300274 阳光电源 63,747,241.67 9.48 非公开发行认购

2 002223 鱼跃医疗 32,082,560.79 4.77 非公开发行认购

3	600335	国机汽车	21,209,648.32	3.15	非公开发行认购
4	002541	鸿路钢构	20,466,355.20	3.04	非公开发行认购
5	002528	英飞拓	20,353,978.80	3.03	非公开发行认购
6	002583	海能达	20,252,254.48	3.01	非公开发行认购
7	603939	益丰药房	19,544,400.00	2.91	非公开发行认购
8	300373	扬杰科技	18,211,755.21	2.71	非公开发行认购
9	300317	珈伟股份	17,619,057.75	2.62	非公开发行认购
10	002400	省广股份	17,025,037.60	2.53	非公开发行认购

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。

第十二部分 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

2016.05.31-2016.09.30 0.20% 0.07% 4.35% 0.46% -4.15% -0.39%

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、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金上市费及年费
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的账户开户费用、账户维护费用；

10、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 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类中第 3—10 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。

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项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于2016年4月30日刊登的本基金原招募说明书（博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金说明书）进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要补充和更新的内容如下：

- 1、在“三、基金管理人”中，对基金管理人的基本情况进行了更新；
- 2、在“四、基金托管人”中，对基金托管人的基本情况进行了更新；
- 3、在“五、相关服务机构”中，对审计基金财产的会计师事务所进行了更新；
- 4、在“六、基金的募集与基金合同的生效”中，更新了募集情况与生效时间；
- 5、在“七、基金份额的上市交易”中，更新了上市交易的时间；
- 6、在“八、基金份额的申购、赎回与转换”中，更新了申购金额的限制，赎回份额的限制；
- 7、在“九、基金的投资”中，更新了“（十一）基金投资组合报告”的内容，数据内容截止时间为2016年9月30日；
- 8、在“十、基金的业绩”中，新增了基金业绩的内容，数据内容截止时间为2016年9月30日；
- 9、在“二十、基金托管协议的内容摘要”中，更新了基金托管人法人代表、注册资本信息；
- 10、在“二十二、其它应披露的事项”中根据最新情况对相关应披露事项进行了更新：
 - （一）、2016年11月19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《关于博时基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行股票的公告》；
 - （二）、2016年11月17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《关于博时基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行股票的公告》；
 - （三）、2016年11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《关于博时基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行股票的公告》

02》、《关于博时基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行股票的公告 01》；

(四)、 2016 年 10 月 24 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《博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告》

；

(五)、 2016 年 09 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《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告 2016092702》、《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告 2016092701》；

(六)、 2016 年 09 月 23 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《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

(七)、 2016 年 09 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《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

(八)、 2016 年 09 月 10 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《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

(九)、 2016 年 09 月 09 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《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

(十)、 2016 年 09 月 03 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《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

(十一)、 2016 年 09 月 02 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《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

(十二)、 2016 年 08 月 31 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《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

(十三)、 2016 年 08 月 23 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《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》、《博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金上市交易提示性公告》

；

(十四)、 2016年08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《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

(十五)、 2016年08月19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《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

(十六)、 2016年08月18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《博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金上市交易公告书》、《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金开通系统内转托管和跨系统转托管业务的公告》、《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

(十七)、 2016年07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《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

(十八)、 2016年07月21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《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

(十九)、 2016年07月19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《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

(二十)、 2016年07月06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《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

(二十一)、 2016年06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《关于博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

(二十二)、 2016年06月08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《博时基金管理有限公司关于调整旗下部分基金的申购、定投、最低持有数量限制的公告》；

(二十三)、 2016年06月01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《博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告》；

博时基金管理有限公司

2017 年 1 月 14 日