

## 博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

### 【重要提示】

博时裕祥分级债券型证券投资基金于 2011 年 5 月 13 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2011]708 号文核准募集，基金合同于 2011 年 6 月 10 日生效。根据基金合同的有关规定，基金合同生效满 3 年后，满足基金合同约定的存续条件，博时裕祥分级债券型证券投资基金无需召开基金份额持有人大会，已自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称已变更为“博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）”。裕祥 A 和裕祥 B 的基金份额，已转换为博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）的不同类别份额。

本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。

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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金的特定风险等。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

本基金在封闭期内，裕祥 A 份额表现为风险较低、收益相对稳定的特征，但在本基金资产出现极端损失情况下，裕祥 A 仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金受损的风险；裕祥 B 份额则表现出风险较高、收益较高的显著特征，由于本基金的资产及收益的分配将优先满足裕祥 A 的约定应得收益的分配，在本基金资产出现极端损失而仅能乃至未能满足裕祥 A 的约定应得收益与投资本金的情况下，则裕祥 B 基金份额可能面临投资本金亏损。

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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

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

本招募说明书更新所载内容截止日为 2016 年 12 月 10 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）

## 一、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和实施，公司互联网金融的平台建设、业务拓展和客户运营，推动公司相关业务在互联网平台的整合与创新。客户服务中心负责零售客户的服务和咨询工作。

董事会办公室专门负责股东会、董事会、监事会及董事会各专业委员会各项会务工作；股东关系管理与董、监事的联络、沟通及服务；基金行业政策、公司治理、战略发展研究；与公司治理及发展战略等相关的重大信息披露管理；政府公共关系管理；党务工作；博时慈善基金会的管理及运营等。办公室负责公司的战略规划研究、行政后勤支持、会议及文件管理、公司文化建设、品牌传播、对外媒体宣传、外事活动管理、档案管理以及工会工作等。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、员工沟通、人力资源信息管理工作。财务部负责公司预算管理、财务核算、成本控制、财务分析等工作。信息技术部负责信息系统开发、网络运行及维护、IT 系统安全及数据备份等工作。基金运作部负责基金会计和基金注册登记等业务。风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察，并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。

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

截止到 2016 年 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月起到中国长城资产管理公司工作，先后在总部国际业务部、人力资源部担任总经理；2008年8月起先后到中国长城资产管理公司天津办事处、北京办事处担任总经理；2014年3月至今担任中国长城资产管理公司控股的长城国富置业有限公司监事、监事会主席，长城环亚国际投资有限公司董事；2015年7月起任博时基金管理有限公司监事。

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

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

黄健斌先生，工商管理硕士。1995年起先后在广发证券有限公司、广发基金管理有限责任公司投资管理部、中银国际基金管理有限公司基金管理部工作。2005年加入博时基金管理公司，历任固定收益部基金经理、博时平衡配置混合型基金经理、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

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Lowe's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(2005年8月24日至2010年8月3日)、固定收益部副总经理、博时转债增强债券型证券投资基金(2010年11月24日至2013年9月25日)、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金的基金经理(2013年2月1日至2014年4月2日)、博时双债增强债券型证券投资基金基金经理(2013年9月13日至2015年7月16日)、博时新财富混合型证券投资基金的基金经理(2015年6月24日至2016年7月4日)。现任董事总经理兼固定收益总部公募基金组投资总监兼、博时信用债券投资基金基金经理(2009年6月10日至今)、博时稳健回报基金的基金经理(2014年1月8日至今)、博时新收益灵活配置混合型证券投资基金(2016年2月29日至今)、博时新机遇混合型证券投资基金(2016年3月29日至今)、博时新价值灵活配置混合型证券投资基金(2016年3月29日至今)、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金(2016年8月1日至今)、博时鑫源灵活配置混合型证券投资基金(2016年9月6日至今)、博时乐臻定期开放混合型证券投资基金(2016年9月29日至今)、博时新起点灵活配置混合型证券投资基金(2016年

10月17日至今)、博时双债增强债券型证券投资基金(2016年10月24日至今)的基金经理。

历任基金经理: 2011年6月到2014年1月,陈芳菲女士。

#### 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Lowe's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。

### 三、基金管理人的职责

- 1、依法申请并募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- 4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- 5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 6、按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- 7、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- 8、进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- 9、依法接受基金托管人的监督；
- 10、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 11、采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- 12、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 14、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- 15、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 16、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；
- 17、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 18、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- 19、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 22、法律法规、基金合同及中国证监会规定的其它义务。

### 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，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：
  - (1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

- (2) 不公平地对待管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

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

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

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

#### 五、基金经理承诺

- 1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- 2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- 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

险管理建议。

#### (4) 监察法律部

监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标。

#### (5) 风险管理部

风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

#### (6) 业务部门

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

### 3、风险管理和内部风险控制的措施

#### (1) 建立内控结构，完善内控制度

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

#### (2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制

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

#### (3) 建立、健全岗位责任制

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

#### (4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序

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

#### (5) 建立有效的内部监控系统

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

#### (6) 使用数量化的风险管理手段

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

#### (7) 提供足够的培训

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

## 二、基金托管人

### 一、基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

## 2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2016年9月30日，本集团总资产55,639.90亿元人民币，高级法下资本充足率14.16%，权重法下资本充足率12.73%。

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

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

经过十四年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2016年招商银行加大高收益托管产品营销力度，截至11月末新增托管公募开放式基金80只，新增首发公募开放式基金托管规模566.49亿元。克服国内证券市场震荡的不利形势，托管费收入、托管资产均创出历史新高，实现托管费收入40.54亿元，同比增长29.28%，托管资产余额9.62万亿元，同比增长52.89%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人，成功签约“壹基金”公益资金托管，为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索，该项目荣获2012中国金融品牌「金象奖」“十大公益

项目”奖；四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获奖项国内托管银行，该行“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”。

## 二、主要人员情况

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

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

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

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

## 三、基金托管业务经营情况

截至2016年11月30日，招商银行股份有限公司累计托管231只开放式基金及其它托管资产，托管资产为9.62万亿元人民币。

## 四、托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

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

### 2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在总行层面对风险进行预防和控制。

二级防范是总行资产托管部设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总

经理室直接领导下，独立于部门内其他业务室和托管分部、分行资产托管业务主管部门，对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督，及时发现内部控制缺陷，提出整改方案，跟踪整改情况。

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

### 3、内部控制原则

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### 4、内部控制措施

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

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

(3) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部采用加密方式传输数据。数据执行异地同步灾备，

同时，每日实时对托管业务数据库进行备份，托管业务数据每日进行备份，所有的业务信息须经过严格的授权才能进行访问。

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

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

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

## 五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。

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

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

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

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

## 三、相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、直销机构

(1) 博时基金管理有限公司北京分公司及北京直销中心

名称： 博时基金管理有限公司北京分公司及北京直销中心

地址： 北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

电话： 010-65187055

传真： 010-65187032

联系人： 尚继源

全国统一客服热线： 95105568（免长途话费）

(2) 博时基金管理有限公司上海分公司

名称： 博时基金管理有限公司上海分公司

地址： 上海市黄浦区中山南路 28 号久事大厦 25 层

电话： 021-33024909

传真： 021-63305180

联系人： 周明远

(3) 博时基金管理有限公司总公司

名称： 博时基金管理有限公司总公司

地址： 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 35 层

电话： 0755-83169999

传真： 0755-83199450

联系人： 程姣姣

2、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： 易会满

联系人： 杨菲

传真： 010-66107914

客户服务电话： 95588

网址： <http://www.icbc.com.cn/>

(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： 蒋超良

客户服务电话： 95599

网址： <http://www.abchina.com>

(3) 中国银行股份有限公司

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

(4) 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号院1号楼  
法定代表人：王洪章  
联系人：张静  
传真：010-66275654  
客户服务电话：95533  
网址：<http://www.ccb.com/>

(5) 交通银行股份有限公司

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

(6) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号  
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号  
法定代表人：李建红  
联系人：邓炯鹏  
电话：0755-83198888

传真： 0755-83195049  
客户服务电话： 95555  
网址： <http://www.cmbchina.com/>

(7) 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 9 号文化大厦  
法定代表人： 李庆萍  
联系人： 廉赵峰  
传真： 010-89937369  
客户服务电话： 95558  
网址： <http://bank.ecitic.com/>

(8) 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>

(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>

(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：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/>

(11)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>

(12)华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街22号

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：吴建

联系人：郑鹏

电话：010—85238667

传真：010—85238680

客户服务电话：95577

网址：<http://www.hxb.com.cn/>

(13)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>

(14) 广发银行股份有限公司

注册地址：广州市越秀区农林下路 83 号

办公地址：广州市越秀区农林下路 83 号

法定代表人：董建岳

联系人：李静筠

电话：020-38321739

传真：020-87311780

客户服务电话：4008308003

网址：<http://www.cgbchina.com.cn/>

(15) 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>

(16) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

电话： 0574-89068340  
传真： 0574-87050024  
客户服务电话： 95574  
网址： <http://www.nccb.com.cn>

(17)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/>

(18)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： <http://www.czbank.com>

(19)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>

(20)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: 陈震山

联系人: 严峻

电话: 0571-85108195

传真: 0571-85106576

客户服务电话: 95398

网址: <http://www.hzbank.com.cn>

(21)温州银行股份有限公司

注册地址: 温州市车站大道 196 号

办公地址: 温州市车站大道 196 号

法定代表人: 邢增福

联系人: 林波

电话: 0577-88990082

传真: 0577-88995217

客户服务电话: (0577) 96699

网址: <http://www.wzbank.cn>

(22)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 号汉口银行大厦

办公地址: 武汉市江汉区建设大道 933 号汉口银行大厦

法定代表人: 陈新民

联系人: 李欣

电话: 027-82656704

传真: 027-82656236

客户服务电话: 027-96558 (武汉); 4006096558 (全国)

网址: <http://www.hkbchina.com>

(23) 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/>

(24) 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>

(25) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册地址： 常州市延陵中路 668 号

办公地址： 常州市和平中路 413 号

法定代表人： 陆向阳

联系人： 包静

电话： 0519-89995066

传真： 0519-89995170

客户服务电话： 0519-96005

网址： <http://www.jnbank.cc>

(26) 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：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层

法定代表人：林义相

联系人：尹伶

电话：010-66045529

传真：010-66045500

客户服务电话：010-66045678

网址：<http://www.txsec.com>

(27) 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/>

(28) 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>

(29) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场 1501-1504

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场 1501-1504

法定代表人：陈洪生

联系人：徐明静

电话： 0592-3122716  
传真： 0592-8060771  
客户服务电话： 400-918-0808  
网址： [www.xds.com.cn](http://www.xds.com.cn)

(30) 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>

(31) 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](http://www.jjmmw.com)

(32) 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>

(33)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>

(34)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>

(35)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>

(36)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](http://www.5ifund.com)

(37)北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址： 北京市顺义区后沙峪镇安富街6号  
办公地址： 北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层  
法定代表人： 闫振杰  
联系人： 焦琳  
电话： 010-62020088-8288  
传真： 010-62020088-8802  
客户服务电话： 400-888-6661  
网址： <http://www.myfund.com>

(38)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/>

(39)浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址： 拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室  
办公地址： 拱墅区登云路55号（锦昌大厦）1号楼金观诚营业大厅

法定代表人： 陈崢  
联系人： 周立枫  
电话： 0571-88337598  
传真： 0571-88337666  
客户服务电话： 400-068-0058  
网址： <http://www.jincheng-fund.com/>

(40) 嘉实财富管理有限公司

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

(41) 众升财富（北京）基金销售有限公司

注册地址： 北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室  
办公地址： 北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08  
法定代表人： 李招弟  
联系人： 李艳  
电话： 010-59497361  
传真： 010-64788016  
客户服务电话： 400-059-8888  
网址： [www.zscffund.com](http://www.zscffund.com)

(42) 北京增财基金销售有限公司

注册地址： 北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号  
办公地址： 北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室  
法定代表人： 王昌庆  
联系人： 罗细安  
电话： 010-67000988

传真： 010-67000988-6000  
客户服务电话： 400-001-8811  
网址： <http://www.zcvc.com.cn>

(43)深圳腾元基金销售有限公司

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

(44)深圳宜投基金销售有限公司

注册地址： 深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街 1 号深港合作区管理局综合办公楼 A 栋 201  
办公地址： 深圳市福田区金田路 2028 号皇岗商务中心 2405  
法定代表人： 华建强  
联系人： 马文静  
电话： 0755-23919681  
传真： 0755-88603185  
客户服务电话： 4008-955-811  
网址： [www.yitfund.com](http://www.yitfund.com)

(45)一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址： 北京市西城区车公庄大街 9 号院 5 号楼 702  
办公地址： 北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界 A 座 2208  
法定代表人： 吴雪秀  
联系人： 段京璐  
电话： 010-88312877  
传真： 010-88312099  
客户服务电话： 400-001-1566

网址: <http://www.yilucaifu.com>

(46)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](http://www.qianjing.com)

(47)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](http://www.fundhaiyin.com)

(48)上海汇付金融服务有限公司

注册地址: 上海市黄浦区中山南路100号19层

办公地址: 上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19层

法定代表人: 冯修敏

联系人: 黄敏儿

电话: 021-33323999

传真: 021-33323830

客户服务电话: 400-820-2819

网址: [fund.bundtrade.com](http://fund.bundtrade.com)

(49)上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址： 上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址： 上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦四楼

法定代表人： 陈继武

联系人： 李晓明

电话： 021-63333319

传真： 021-63332523

客户服务电话： 400-643-3389

网址： [www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

(50)北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址： 北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603

办公地址： 北京市朝阳区西大望路 1 号温特莱中心 A 座 16 层

法定代表人： 董浩

联系人： 于婷婷

电话： 010-56409010

传真： 010-56580660

客户服务电话： 400-618-0707

网址： [www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)

(51)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](http://www.jinqianwo.cn)

(52)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

(53)大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

联系人：何庭宇

电话：021-20324199

传真：021-22268089

客户服务电话：400-928-2299

网址：www.dtfunds.com

(54)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

(55)奕丰金融服务（深圳）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（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1116 室及 1307 室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人： 许雅君  
电话： 0755-89460502  
传真： 0755-21674453  
客户服务电话： 0755-89460500  
网址： [www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(56)北京懒猫金融信息服务有限公司

注册地址： 北京市石景山区石景山路 31 号院盛景国际广场 3 号楼 1119  
办公地址： 北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区 1111 号 6 层  
法定代表人： 许贤良  
联系人： 肖金凤  
电话： 01056050791  
客户服务电话： 400-150-0882  
网址： [www.lanmao.com](http://www.lanmao.com)

(57)大连网金金融信息服务有限公司

注册地址： 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号 2 层 202 室  
办公地址： 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号 2 层 202 室  
法定代表人： 卜勇  
联系人： 卜勇  
电话： 0411-39027800  
传真： 0411-39027888  
客户服务电话： 400-089-9100  
网址： <http://www.yibaijin.com/>

(58)北京蛋卷基金销售有限公司

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

网址: danjuanapp.com

(59) 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

(60) 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

(61) 东海期货有限责任公司

注册地址: 江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号

办公地址: 上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦8楼

法定代表人: 陈太康

联系人: 李天雨

电话: 021-68757102

传真: 021-68757102

客户服务电话: 95531

网址: www.qh168.com.cn

(62) 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](http://www.gtja.com)

(63) 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/>

(64) 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/>

(65) 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： 中国深圳福田区益田路江苏大厦 A 座 30 楼

法定代表人： 宫少林

联系人： 黄婵君

电话： 0755-82943666

传真： 0755-83734343

客户服务电话： 4008888111； 95565

网址： <http://www.newone.com.cn/>

(66) 广发证券股份有限公司

注册地址： 广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址： 广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人： 孙树明

联系人： 黄崑

电话： 020-87555888

传真： 020-87555305

客户服务电话： 95575 或致电各地营业网点

网址： <http://www.gf.com.cn/>

(67) 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/>

(68) 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： 陈有安

联系人： 邓颜

电话： 010-66568292  
传真： 010-66568990  
客户服务电话： 4008888888  
网址： <http://www.chinastock.com.cn/>

(69)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/>

(70)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](http://www.swhysc.com)

(71)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/>

(72)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/>

(73)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>

(74)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/>

(75) 万联证券有限责任公司

注册地址： 广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

办公地址： 广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 栋 18、19 层

法定代表人： 张建军

联系人： 王鑫

电话： 020-38286686

传真： 020-22373718-1013

客户服务电话： 4008888133

网址： <http://www.wlzq.com.cn>

(76) 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： <http://www.gyzq.com.cn>

(77) 渤海证券股份有限公司

注册地址： 天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址： 天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人： 王春峰

联系人： 胡天彤

电话： 022-28451861

传真： 022-28451892

客户服务电话： 4006515988

网址： <http://www.bhzq.com>

(78) 华泰证券股份有限公司

注册地址： 南京市江东中路 228 号

办公地址： 办公地址 南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道  
4011 号港中旅大厦 18 楼  
法定代表人： 周易  
联系人： 庞晓芸  
电话： 0755-82492193  
传真： 0755-82492962（深圳）  
客户服务电话： 95597  
网址： <http://www.htsc.com.cn/>

(79) 山西证券股份有限公司

注册地址： 太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼  
办公地址： 太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼  
法定代表人： 侯巍  
联系人： 郭熠  
电话： 0351-8686659  
传真： 0351-8686619  
客户服务电话： 4006661618  
网址： <http://www.i618.com.cn/>

(80) 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>

(81) 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>

(82) 东吴证券股份有限公司  
注册地址： 江苏省苏州市翠园路 181 号  
办公地址： 江苏省苏州市星阳街 5 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： 4008601555  
网址： <http://www.dwjq.com.cn>

(83) 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>

(84) 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 21 层-29 层  
法定代表人： 潘鑫军  
联系人： 胡月茹  
电话： 021-63325888  
传真： 021-63326729

客户服务电话： 95503

网址： <http://www.dfzq.com.cn>

(85)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.foundersc.com>

(86)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>

(87)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： 400888788；95525

网址： <http://www.ebscn.com/>

(88)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>

(89)东北证券股份有限公司

注册地址： 吉林省长春市自由大路1138号

办公地址： 吉林省长春市自由大路1138号

法定代表人： 矫正中

联系人： 潘锴

电话： 4006-000-686

传真： 0431-85096795

客户服务电话： 0431-85096709

网址： <http://www.nesc.cn>

(90)南京证券股份有限公司

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： 步国旬

联系人： 潘月

电话： 025-52310569

传真： 025-52310586

客户服务电话： 4008285888

网址： <http://www.njq.com.cn>

(91)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](http://www.962518.com)

(92)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>

(93)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>

(94)浙商证券股份有限公司

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： 张智  
电话： 021-64718888  
传真： 0571-87901913  
客户服务电话： 95345  
网址： <http://www.stocke.com.cn/>

(95)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/>

(96)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/>

(97)国海证券股份有限公司

注册地址： 广西桂林市辅星路 13 号  
办公地址： 深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦 3 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： 400888100（全国）， 96100（广西）

网址： <http://www.ghzq.com.cn>

(98)财富证券有限责任公司

注册地址： 长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

办公地址： 长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

法定代表人： 蔡一兵

联系人： 郭磊

电话： 0731-84403319

传真： 0731-84403439

客户服务电话： 0731-84403360

网址： <http://www.cfzq.com/>

(99)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： 张巧玲

电话： 0769-22116572

传真： 0769-22116999

客户服务电话： 0769-961130

网址： <http://www.dgzq.com.cn>

(100)中原证券股份有限公司

注册地址： 郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址： 郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人： 菅明军

联系人： 程月艳

电话： 0371—65585670

传真： 0371—65585665

客户服务电话： 0371-967218;4008139666

网址： <http://www.ccnew.com/>

(101)国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

客户服务电话：400-818-8118

网址：<http://www.guodu.com>

(102)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；4008888588

网址：<http://www.longone.com.cn>

(103)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：马跃进

联系人：汪代强

电话：0791-6285337

传真：0791-6289395

客户服务电话：4008222111

网址：<http://www.gsstock.com/>

(104)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>

(105)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>

(106)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： <http://www.qlzq.com.cn/>

(107)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](http://www.firstcapital.com.cn)

(108)金元证券股份有限公司

注册地址： 海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼  
办公地址： 深圳市福田区深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼  
法定代表人： 陆涛  
联系人： 马贤清  
电话： 0755-83025022  
传真： 0755-83025625  
客户服务电话： 4008-888-228  
网址： [http:// www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

(109)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： 王宜四  
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： <http://www.avicsec.com/>

(110)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： <http://www.tebon.com.cn>

(111)西部证券股份有限公司

注册地址： 陕西省西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16-17 楼

办公地址： 西安市西五路海惠大厦 4 层 422 室

法定代表人： 刘建武

联系人： 冯萍

电话： 029-87406488

传真： 029-87406387

客户服务电话： 95582

网址： <http://www.westsecu.com/>

(112)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 至 10 层

法定代表人： 黄金琳

联系人： 张宗悦

电话： 0591-87383623

传真： 0591-87383610

客户服务电话： 96326（福建省外请加拨 0591）

网址： <http://www.hfzq.com.cn>

(113)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： 甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦

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： <http://www.hlzqgs.com/>

(114) 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/>

(115) 财通证券股份有限公司

注册地址： 杭州市解放路 111 号

办公地址： 杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 1602 室

法定代表人： 沈继宁

联系人： 董卿

电话： 0571-87822359

传真： 0571-87925100

客户服务电话： 96336（上海地区 962336）

网址： <http://www.ctsec.com>

(116) 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>

(117) 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：程宜荪  
联系人：牟冲  
电话：010-5832 8112  
传真：010-5832 8748  
客户服务电话：4008878827  
网址：<http://www.ubssecurities.com>

(118)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/>

(119)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大厦7层、8层  
办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦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>

(120)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： <http://www.rxzq.com.cn>

(121)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： 张背北  
电话： 0451-85863696  
传真： 0451-82287211  
客户服务电话： 4006662288  
网址： <http://www.jhzq.com.cn>

(122)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>

(123)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>

(124)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>

(125)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>

(126)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： 吴骏

联系人： 吴尔晖

电话： 0755-83007159

传真： 0755-83007034

客户服务电话： 4000-188-688

网址： <http://www.ydsc.com.cn>

(127)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： <http://www.daton.com.cn>

(128)华创证券有限责任公司

注册地址： 贵州省贵阳市

办公地址： 贵州省贵阳市中华北路 216 号华创大厦

法定代表人： 陶永泽

联系人： 郭佳来

电话： 021-60762618

传真： 021-60762700

客户服务电话： 021-60762618

网址： <http://www.hczq.com/Index.html>

(129)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](http://www.qzccb.com)

### 3、场内代销机构

基金份额办理场内认购业务的发售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员（具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告）。尚未取得相应业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后，代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，增加其他符合要求的机构代理销售本基金，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：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

办公地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：陈耀先

电话：010-58598839

传真：010-58598834

联系人：朱立元

### 三、律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：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

电话：021- 31358666

传真：021- 31358600

联系人：安冬

经办律师：吕红、安冬

### 四、会计师事务所和经办注册会计师

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

### 四、基金的名称

博时稳健回报债券型证券投资基金

### 五、基金的类型

本基金运作方式为契约型开放式，存续期间为不定期。

### 六、基金的投资目标

在谨慎投资的前提下，本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

## 七、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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的相关规定）。

本基金也可投资于非固定收益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购或增发新股，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金应在其可交易之日起的30个交易日内卖出。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于非债券资产的比例不高于基金资产的20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

## 八、投资策略

通过宏观方面自上而下的分析及债券市场方面自下而上的判断，把握市场利率水平的运行态势，根据债券市场收益率曲线的整体运动方向进行久期选择。在微观方面，基于债券市场的状况，主要采用骑乘、息差及利差策略等投资策略。同时积极参与一级市场新股、债券申购，提高组合预期收益水平。

### 1、资产配置策略

本基金为债券型基金，基金的资产配置比例范围为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于非债券资产的比例不高于基金资产的20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金可参与一级市场新股申购或增发新股等，但不直接从二级市场买入股票或权证，对股票等权益类证券的投资比例不超过基金资产的20%。

在以上战略性资产配置的基础上，本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法，在各类资产之间进行相对稳定的动态配置。

### 2、固定收益类品种投资策略

灵活应用各种期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、期权策略，在合理管理并控制组合风险的前提下，最大化组合收益。

（1）期限结构策略。通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类型债券进行久期配置。具体来看，又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

1) 骑乘策略是当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。

2) 子弹策略是使投资组合中债券久期集中于收益率曲线的一点，适用于收益率曲线较陡时；杠铃策略是使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端，适用于收益率曲线两头下降较中间下降更多的蝶式变动；梯式策略是使投资组合中的债券久期均匀分布于收益率曲线，适用于收益率曲线水平移动。

（2）信用策略。信用债收益率等于基准收益率加信用利差，信用利差收益主要受两个方面的影响，一是该信用债对应信用水平的市场平均信用利差曲线走势；二是该信用债本身的信用变化。

基于这两方面的因素，本基金管理人分别采用以下的分析策略：

1) 基于信用利差曲线变化策略：一是分析经济周期和相关市场变化对信用利差曲线的影响，二是分析信用债市场容量、结构、流动性等变化趋势对信用利差曲线的影响。综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的及分行业投资比例。

2) 基于信用债信用变化策略：发行人信用发生变化后，本基金管理人将采用变化后债券信用评级所对应的信用利差曲线对公司债、企业债定价。影响信用债信用变化的风险因素分为行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险等五个方面。本基金主要依靠内部评级系统分析信用债的相对信用水平、违约风险及理论信用利差。

(3) 互换策略。不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面存在差别，投资管理人可以同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种，赚取收益级差。互换策略分为两种：

1) 替代互换。判断未来利差曲线走势，比较期限相近的债券的利差水平，选择利差较高的品种，进行价值置换。由于利差水平受流动性和信用水平的影响，因此该策略也可扩展到新老券置换、流动性和信用的置换，即在相同收益率下买入近期发行的债券，或是流动性更好的债券，或在相同外部信用评级和收益率下，买入内部信用评级更高的债券。

2) 市场间利差互换。一般在信用债和国债之间进行。如果预期信用利差扩大，则用国债替换信用债；如果预期信用利差缩小，则用信用债替换国债。

(4) 息差策略。通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，从而获得杠杆放大收益。

(5) 期权策略。本基金投资的主要含权债为可转换债券，因此该策略主要适用于可转换债券。可转换债券是介于股票和债券之间的投资品种，兼具股性和债性的双重特征。本基金利用宏观经济变化和上市公司的盈利变化，判断市场的变化趋势，选择不同的行业，再根据可转换债券的特性选择各行业不同的转债品种。本基金利用可转换债券的债券底价和到期收益率来判断转债的债性，增强本金投资的安全性；利用可转换债券溢价率来判断转债的股性，在市场出现投资机会时，优先选择股性强的品种，获取超额收益。

在选择可转换债券品种时，本基金将与公司的股票投研团队积极合作，对发行可转债的上市公司的基本面做出价值分析，力求选择被市场低估的品种，来构建本基金可转换债券的投资组合。

### 3、权益类品种投资策略

本基金可参与一级市场新股申购或增发新股等，包括在新股冻结期限内所发生的送股、配股、权证等权益投资。本基金不直接从二级市场买入股票或权证，但因可转债转股所形成的股票及股票派发，因分离交易可转债分离交易的权证等除外。本基金对股票等权益类证券的投资比例不超过基金资产的 20%。

我国现行的新股、可转债及可分离债的发行制度为基金等机构投资者发挥资金优势和专业估值优势提供了机会。申购决策主要考虑一、二级市场溢价率，中签率和申购机会成本三个方面。可转债的定价关键是选取合适的定价模型和参数（主要分析波动率、正股价格等），在定价过程中充分考虑对应市场的平均估值水平和近期发行的可转债估值水平，以契合当时的投资环境。

### 4、投资程序

投资决策委员会是本基金的最高决策机构，定期或遇重大事件时就投资管理业务的重大问题进

行讨论，并对本基金投资做方向性指导。基金经理、研究员、交易员各司其责，相互制衡。具体的投资流程为：

- (1) 投资决策委员会定期召开会议，确定本基金的总投资思路和投资原则；
- (2) 研究部宏观策略分析师基于自上而下的研究为本基金提供总的资产配置建议；固定收益部数量及信用分析师为固定收益类投资决策提供依据；研究部行业研究员为信用债券品种的信用分析提供研究支持；
- (3) 固定收益部、股票投资部每周、每月召开投资例会，根据投资决策委员会的决定，结合市场和个券的变化，制定具体的投资策略；
- (4) 基金经理依据投委会的决定，参考研究员的投资建议，结合风险控制和业绩评估的反馈意见，根据市场情况，制定并实施具体的投资组合方案；
- (5) 基金经理向交易员下达指令，交易员执行后向基金经理反馈；
- (6) 监察法律部对投资的全过程进行风险监控；
- (7) 风险管理部对基金投资进行业绩评估并反馈给基金经理。

## 九、业绩比较基准

本基金整体的业绩比较基准为：中证全债指数收益率

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，也是中证指数有限公司编制并发布的首只债券类指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标，为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。

本基金选择中证全债指数作为业绩比较基准主要考虑如下：

- 1、本基金是债券型基金，主要投资于各类固定收益类金融工具，强调基金资产的稳定增值，中证全债指数作为业绩比较基准符合本基金的风险收益特征。
- 2、中证全债指数自 2007 年 12 月发布以来，已经得到了投资者的广泛认同，被众多基金公司、保险公司和其他机构投资者用作债券投资的基准指数。
- 3、中证全债指数的编制方法遵循国际标准和投资实践，在交易所上市的所有债券和银行间债券市场的所有债券中选择部分交投活跃的券种作为指数的备选样本集合，样本券的剩余期限至少 1 年，信用评级在投资级以上。可见，该指数能够敏锐、直接、全面地反映债券市场对利率的预期及债券市场的走势，具有一致、透明和流动性较高等优点。

为此，本基金选取中证全债指数作为本基金的业绩比较基准。

若未来市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整业绩比较基准并及时公告。

## 十、风险收益特征

从基金整体运作来看，本基金属于中低风险品种，预期收益和风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

从两类份额看，裕祥 A 持有人的年化约定收益率为一年期定期存款利率+1.50%，表现出风险较低、收益相对稳定的特点。裕祥 B 获得剩余收益，带有适当的杠杆效应，表现出风险较高，收益较高的特点，其预期收益要高于普通纯债型基金。

## 十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 9 月 30 日。本报告财务数据未经审计师审计。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 --

其中：股票 --

2 固定收益投资 251,987,500.00 96.19

其中：债券 251,987,500.00 96.19

资产支持证券 --

3 贵金属投资 --

4 金融衍生品投资 --

5 买入返售金融资产 --

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

6 银行存款和结算备付金合计 4,402,812.55 1.68

7 其他各项资产 5,586,890.82 2.13

8 合计 261,977,203.37 100.00

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 9,509,500.00 4.18

2 央行票据 --

3 金融债券 170,245,000.00 74.88

其中：政策性金融债 170,245,000.00 74.88

4 企业债券 72,233,000.00 31.77

5 企业短期融资券 --

6 中期票据 --

7 可转债（可交换债） --

8 同业存单 --

9 其他 --

10 合计 251,987,500.00 110.84

#### 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150210	15 国开 10	900,000	96,876,000.00	42.61
2	1180075	11 鄂城投债	700,000	72,233,000.00	31.77
3	150205	15 国开 05	500,000	52,245,000.00	22.98
4	160205	16 国开 05	200,000	21,124,000.00	9.29
5	019539	16 国债 11	95,000	9,509,500.00	4.18

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

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

(2) 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1	存出保证金	5,313.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,473,162.30
5	应收申购款	108,415.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,586,890.82

(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。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(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。

## 十二、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，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

历史各时间段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：

### 1、博时裕祥分级债券型证券投资基金

期 间 ①份额净值增长率 ②份额净值增长率标准差 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

2011年6月10日至2011年12月31日 3.02% 0.50% 4.17% 0.13% -1.15% 0.37%

2012年1月1日至2012年12月31日 8.77% 0.69% 3.52% 0.07% 5.25% 0.62%

2013年1月1日至2013年12月31日 1.76% 0.16% -1.07% 0.10% 2.83% 0.06%

2014年1月1日至2014年3月31日 -1.23% 0.16% 2.66% 0.08% -3.89% 0.08%

2011年6月10日至2014年6月9日 15.00% 0.46% 12.33% 0.10% 2.67% 0.36%

注：根据《博时裕祥分级债券型证券投资基金基金合同》和《博时裕祥分级债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，自2014年6月10日博时裕祥分级债券型证券投资基金之裕祥B（150043）终止上市之日起，原博时裕祥分级债券型证券投资基金转型为博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）。

### 2、博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）

博时稳健回报债券（LOF）A：

期 间 ①份额净值增长率 ②份额净值增长率标准差 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

2014年6月10日-2014年12月31日 24.51% 1.03% 5.25% 0.11% 19.26% 0.92%

2015年1月1日-2015年12月31日 8.59% 0.29% 8.74% 0.08% -0.15% 0.21%

2016年1月1日-2016年9月30日 4.13% 0.17% 3.86% 0.06% 0.27% 0.11%

2014年6月10日-2016年9月30日 40.79% 0.56% 18.86% 0.08% 21.93% 0.48%

博时稳健回报债券（LOF）C：

期 间 ①份额净值增长率 ②份额净值增长率标准差 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

2014年6月10日-2014年12月31日

24.27% 1.03% 5.25% 0.11% 19.02% 0.92%

2015年1月1日-2015年12月31日 8.23% 0.30% 8.74% 0.08% -0.51% 0.22%

2016年1月1日-2016年9月30日 3.79% 0.17% 3.86% 0.06% -0.07% 0.11%

2014年6月10日-2016年9月30日 39.59% 0.56% 18.86% 0.08% 20.73% 0.48%

### 十三、基金费用与税收

#### 一、与基金运作有关的费用

##### (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、销售服务费；
- 4、基金合同生效后的信息披露费用；
- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的上市初费和年费；
- 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) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

##### (三) 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

在通常情况下，基金管理费按基金资产净值的 0.80% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 3、销售服务费

##### (1) 自基金合同生效之日起满 3 年内的销售服务费

自基金合同生效之日起满 3 年内，裕祥 A 基金份额的销售服务费年费率为 0.35%，裕祥 B 基金份额不收取销售服务费。

本基金销售服务费按前一日裕祥 A 基金资产净值的 0.35% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为裕祥 A 基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日裕祥 A 的基金份额参考净值与裕祥 A 的基金份额数的乘积

销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

#### (2) 自基金合同生效之日起满3年后的销售服务费

自本基金基金合同生效之日起满3年后，本基金将转换为上市开放式基金（LOF），其中A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.35%。

本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.35%年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

上述基金费用的种类中第4-9项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 二、与基金销售有关的费用

### 1、申购费率

本基金A类基金份额场内场外均可进行申购赎回，C类基金份额只能在场外进行申购赎回；其中A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

投资者在场外申购本基金时交纳申购费用。投资者交纳前端申购费用时，按申购金额采用比例费率。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

表：基金的场外申购费率结构

#### A类基金份额

申购金额M 申购费率

M < 100万元 0.80%

100万元 ≤ M < 300万元 0.50%

300万元 ≤ M < 500万元 0.30%

M ≥ 500万元 按笔收取，1000元/笔

#### C类基金份额

申购费率 0%

因红利自动再投资而产生的基金份额，不收取相应的申购费用。

深圳证券交易所会员单位应按照本基金招募说明书约定的场外申购费率设定投资者的场内申购费率。申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登

记等各项费用。

## 2、赎回费率

场外赎回费率：

表：基金的场外赎回费率结构

A类基金份额

持有年限 Y 赎回费率

Y<1年 0.10%

1年≤Y<2年 0.05%

Y≥2年 0%

注：1年指365天。

C类基金份额

赎回费率 持有期限少于30日的基金份额，赎回费率为0.75%；持有期限不少于30日（含30日）的基金份额，不收取赎回费用。

场内赎回费率：

赎回费率 0.10%

其中，在场外认购、申购并赎回的投资者其份额持有年限以份额实际持有年限为准；在场内认购、场内申购以及场内买入，并转托管至场外赎回的投资者其份额持有年限自份额转托管至场外之日起开始计算；所有份额的场内赎回费率都为0.10%。

## 三、不列入基金费用的项目

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，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。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

## 四、费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

## 五、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十四、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7月25日刊登的本基金原招募说明书（《博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）招募说明书》）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，更新了相关服务机构的内容，各新增代销机构均在指定媒体上公告列示；
- 4、在“十、基金的投资”中，更新了“（十二）基金投资组合报告”的内容；
- 5、在“十一、基金的业绩”中，更新了“自基金合同生效开始基金份额净值增长率”的数据及列表内容，数据内容截止时间为2016年9月30日；
- 6、在“二十四、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《关于博时旗下部分开放式基金增加东海期货有限责任公司为代销机构的公告》；
  - （二）、2016年11月12日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）暂停大额申购、定期定额投资业务的公告》；
  - （三）、2016年11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《关于博时旗下部分开放式基金增加上海好买基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》；
  - （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《博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）2016年第3季度报告》；
  - （五）、2016年09月26日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加江苏江南农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告》；
  - （六）、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《关于博时旗下部分开放式基金增加厦门市鑫鼎盛控股有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》；
  - （七）、2016年08月26日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金新增深圳腾元基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》；
  - （八）2016年08月25日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）2016年半年度报告（摘要）》；
  - （九）、2016年07月25日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）更新招募说明书2016年第2号（摘要）》；
  - （十）、2016年07月20日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加北京蛋卷基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》、《博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）2016年第2季度报告》；
  - （十一）、2016年07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《关于博时旗下部分开放式基金开通上海陆金所资产管理有限公司定投业务并参加其定投业务费率优惠活动的公告》；
  - （十二）、2016年06月30日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分基金继续参加交通银行网上及手机银行申购业务费率优惠活动的公告》；
  - （十三）、2016年06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《关于博时旗下部分开放式基金增加大泰金石投资管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》。

博时基金管理有限公司

2017年1月24日