

# 博时乐臻定期开放混合型

## 证券投资基金更新招募说明书

2017 年第 2 号

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

### 【重要提示】

- 1、本基金根据 2016 年 8 月 26 日中国证券监督管理委员会《关于准予博时乐臻定期开放混合型证券投资基金募集注册的批复》（证监许可[2016]1941 号）。
- 2、基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。
- 3、投资有风险，投资者认购（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。  
本基金的一部分资产将可能投资于中小企业私募债券。由于中小企业私募债券发行门槛低，投资过程中的信用风险也相应增加，有可能出现债券到期后，企业不能按时清偿债务，或者在存续期内评级被下调的风险。中小企业私募债券不能在交易所上市交易，而是通过上证所固定收益证券综合电子平台及深交所综合协议交易平台，或证券公司进行转让，同时，交易所按照申报时间先后顺序对私募债券转让进行确认，对导致私募债券投资者超过 200 人的转让不予确认。因此，本基金在投资中小企业私募债券的过程中，面临着流动性风险。
- 5、本基金的业绩比较基准为中债综合财富（总值）指数\*60%+沪深 300 指数\*40%，但本基金的收益水平有可能不能达到或超过同期的目标收益率水平，投资者面临获得低于目标收益率甚至亏损的风险。
- 6、基金不同于银行储蓄与债券，基金投资者有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及《基金合同》。

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

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

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

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2017 年 9 月 29 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 6 月 30 日。

## 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）83169999

博时基金管理有限公司（以下简称公司）经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准设立。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份 49%；中国长城资产管理公司，持有股份 25%；天津港（集团）有限公司，持有股份 6%；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二十八个直属部门，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、央企业务部、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、公司零售渠道银行总行管理与维护、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。央企业务部负责招商局集团签约机构客户、重要中央企业及其财务公司等客户的拓展、合作业务落地与服务等工作。营销服务部负责营销策划、销售支持、品牌传播、对外媒体宣传等工作。

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、公司文化建设；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。办公室负责公司的行政后勤支持、会议及文件管理、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 2017 年 6 月 30 日，公司总人数为 512 人，其中研究员和基金经理超过 87%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，国信证券投资业务部副总经理，华西证券投资银行总部副总经理、董事总经理。2014年加入中国长城资产管理公司，现任投资投行事业部副总经理。

杨林峰先生，硕士，高级经济师，董事。1988年8月就职于国家纺织工业部，1992年7月至2006年6月任职于中国华源集团有限公司，先后任华源发展股份有限公司（上海证交所上市公司）董秘、副总经理、常务副总经理等职。2006年7月就职于上海市国资委直属上海大盛资产有限公司，任战略投资部副总经理。2007年10月至今，出任上海盛业股权投资基金有限公司执行董事、总经理。2011年7月至2013年8月，任博时基金管理有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。

陈良生先生，中央党校经济学硕士。1980年至2000年就职于中国农业银行巢湖市支行及安徽省分行。2000年起就职于中国长城资产管理公司，历任合肥办事处综合管理部部长、福州办事处党委委员、总经理、福建省分公司党委书记、总经理。2017年4月至今任中国长城资产管理股份有限公司机构协同部专

职董监事。

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年起先后在广州证券有限公司、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员工监事。

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

### 3、高级管理人员

张光华先生，简历同上。

江向阳先生，简历同上。

王德英先生，硕士，副总经理。1995年起先后在北京清华计算机公司任开发部经理、清华紫光股份公司CAD与信息事业部任总工程师。2000年加入博时基金管理有限公司，历任行政管理部副经理，电脑部副经理、信息技术部总经理、公司代总经理。现任公司副总经理，主管IT、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、博时基金(国际)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（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）的基金经理、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的基金经理（2016年10月24日至今）、博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金（2017年1月10日至今）、博时鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金（2017年2月10日至今）、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金（2017年2月10日至今）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。现任董事总经理兼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、博时沪港深价值优选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、博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金、博时鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、博时鑫润灵活配置混合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，现任董事总经理兼年金投资部投资总监、

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。

## 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）

成立日期：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：075583199084

传真：075583195201

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2017年6月30日，本集团总资产61,996.90亿元人民币，高级法下资本充足率14.59%，权重法下资本充足率11.85%。

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74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。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，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；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；2017年6月再度荣膺《财资》中国最佳托管银行奖，全功能网上托管银行2.0荣获《银行家》2017中国金融创新十佳金融产品创新奖。

### （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。

王良先生，本行副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991年至1995年，在中国科技国际信托投资公司工作；1995年6月至2001年10月，历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001年10月至2006年3月，历任北京分行行长助理、副行长；2006年3月至2008年6月，任北京分行党委书记、副行长（主持工作）；2008年6月至2012年6月，任北京分行行长、党委书记；2012年6月至2013年11月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013年11月至2014年12月，任招商银行总行行长助理；2015年1月起担任本行副行长；2016年11月起兼任本行董事会秘书。

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2017年6月30日，招商银行股份有限公司累计托管301只开放式基金。

## 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直销中心

名称：博时基金管理有限公司北京直销中心

地址：北京市建国门内大街18号恒基中心1座23层

电话：010-65187055

传真：010-65187032、010-65187592

联系人：韩明亮

博时一线通：95105568（免长途话费）

##### （2）博时基金管理有限公司上海分公司

名称：博时基金管理有限公司上海分公司

地址：上海市黄浦区中山南路28号久事大厦25层

电话：021-33024909

传真：021-63305180

联系人：郁天娇

##### （3）博时基金管理有限公司总公司

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

## 2、代销机构

### (1) 中国银行股份有限公司

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

### (2) 交通银行股份有限公司

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

### (3) 招商银行股份有限公司

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

### (4) 上海浦东发展银行股份有限公司

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

(5)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：[www.bosc.cn](http://www.bosc.cn)

(6)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：谢永林  
联系人：施艺帆  
电话：021-50979384  
传真：021-50979507  
客户服务电话：95511-3  
网址：<http://bank.pingan.com>

(7)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/>

(8)北京农村商业银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区月坛南街1号院2号楼

办公地址：北京市西城区月坛南街1号院2号楼

法定代表人：王金山

联系人：鲁娟

电话：010-89198762

客户服务电话：96198

网址：<http://www.bjrbc.com>

(9)渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河东区海河东路218号

办公地址：天津市河东区海河东路218号

法定代表人：李伏安

联系人：王宏

电话：022-58316666

传真：022-58316569

客户服务电话：95541

网址：<http://www.cbhb.com.cn>

(10)哈尔滨银行股份有限公司

注册地址：哈尔滨市道里区尚志大街160号

办公地址：哈尔滨市道里区上江街888号

法定代表人：郭志文

联系人：李至北

电话：0451-87792450

传真：0451-87792682

客户服务电话：95537

网址：<http://www.hrbb.com.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：王耀球

联系人：杨亢

电话：0769-22866270

传真： 0769-22866282  
客户服务电话： 961122  
网址： <http://www.drcbank.com/>

(12)成都农村商业银行股份有限公司

注册地址： 四川省成都市武侯区科华中路 88 号  
办公地址： 四川省成都市武侯区科华中路 88 号  
法定代表人： 陈萍  
联系人： 杨琪  
电话： 028-85029649  
传真： 028-85190961  
客户服务电话： 95392  
网址： <http://www.cdrcb.com/>

(13)苏州银行股份有限公司

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

(14)晋商银行股份有限公司

注册地址： 山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦  
办公地址： 山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦  
法定代表人： 阎俊生  
联系人： 董嘉文  
电话： 0351-6819926  
传真： 0351-6819926  
客户服务电话： 95105588  
网址： <http://www.jshbank.com>

(15)福建海峡银行股份有限公司

注册地址： 福州市六一北路 158 号

办公地址：福州台江区江滨中大道 358 号福建海峡银行  
法定代表人：苏素华  
联系人：吴白玫、张翠娟、黄钰雯  
电话：0591-87332762  
传真：0591-87330926  
客户服务电话：400-893-9999  
网址：www.fjhxbank.com

(16)上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室  
办公地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室  
法定代表人：毛淮平  
客户服务电话：13816092323  
网址：<http://www.cwmc.cn/>

(17)首创证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座  
办公地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座  
法定代表人：吴涛  
客户服务电话：4006200620  
网址：[www.sczq.com.cn](http://www.sczq.com.cn)

(18)联储证券有限责任公司

注册地址：  
法定代表人：  
客户服务电话：  
网址：

(19)桂林银行股份有限公司

注册地址：桂林市中山南路 76 号  
办公地址：桂林市中山南路 76 号  
法定代表人：王能  
联系人：周佩玲  
电话：0773-3810130  
传真：0773-3851691  
客户服务电话：400-86-96299

网址：[www.guilinbank.com.cn](http://www.guilinbank.com.cn)

## 二、登记机构

名称：博时基金管理有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

办公地址：北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

法定代表人：张光华

电话：010-65171166

传真：010-65187068

联系人：许鹏

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

经办律师：安冬、陆奇

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 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

博时乐臻定期开放混合型证券投资基金

## 五、基金的类型

混合型

## 六、基金运作方式

契约型定期开放式

## 七、投资目标

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

## 八、投资范围

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、国债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,本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的60%,本基金投资于股票资产比例为基金资产的0%-40%,但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期前1个月、开放期及开放期结束后1个月的期间内,基金投资不受上述比例限制。开放期内每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金以后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。权证投资比例不得超过基金资产净值的3%。

## 九、投资策略

### 1. 债券投资策略

本基金的主要投资策略是买入与封闭期相匹配的债券,并持有到期,或者是持有回售期与封闭期相匹配的债券,获得本金和票息收入;同时,根据所持债券信用状况变化,进行必要的动态调整;在谨慎投资的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

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

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

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

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

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

### 2. 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。

### 3. 中小企业私募债投资策略

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。

### 4. 杠杆投资策略

本基金将综合考虑债券投资的风险收益以及回购成本等因素,在严格控制投资风险的前提下,通过正回购,获得杠杆放大收益。封闭期内,本基金的杠杆比例不超过100%,即基金总资产与基金净资产的比例不超过200%。开放期内,本基金的杠杆比例不超过40%,即基金总资产与基金净资产的比例不超过140%。

### 5. 股票投资策略

(1) 本基金股票投资以定性和定量分析为基础,从基本面分析入手,主要遵循以下三个步骤:

1) 本基金将对股票的风格特征进行评估,从股票池中选择成长与价值特性突出的股票。

根据一系列指标对市场上所有股票的风格特征进行评估。成长股的重要评估指标是考察公司的成长性。价值投资的核心思想是寻找市场上被低估的股票。通过以上评估，初步筛选出成长与价值股票池。

2) 对股票的基本面素质进行筛选，应用基本面分析方法，确定优质成长股与优质价值股的评价标准，在第一步选择出的具有鲜明风格的股票名单中，进一步分析，选出基本面较好的股票。

3) 进行成长与价值的风格配置。本基金将根据对市场的判断，动态地调整成长股与价值股的投资比重，追求在可控风险前提下的稳健回报。

在以上形成的价值股、成长股股票池中，本基金根据对市场趋势的判断、宏观经济环境等因素，对成长与价值股的投资比例进行配置。总体而言，成长股与价值股在股票资产中进行相对均衡的配置，适度调整。以控制因风格带来的投资风险，降低组合波动的风险，提高整体收益率。

## (2) 高股息股票投资策略

重点投资于竞争格局稳定、长期回报优秀的高股息率低估值股票，分析维度主要有行业状况、竞争格局、财务质量、盈利能力、估值水平等。

## 6. 金融衍生品投资策略

### 1) 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。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，力求稳健的投资收益。

### 2) 股指期货、国债期货投资策略

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、国债期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

## 7. 开放期投资策略

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

## 十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数\*60%+沪深 300 指数\*40%

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。中债综合财富（总值）指数由中央国债登记结算有限公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。指数涵盖了银行间市场和交易所市场，具有广泛的市场代表性，适合作为市场债券投资收益的衡量标准；在封闭期，本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 60%，本基金投资于股票资产比例为基金资产的 0%-40%，综合考虑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。

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

## 十一、风险收益特征

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

## 十二、投资组合报告

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

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存

在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 6 月 30 日。

### 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 153,774,912.84 18.60

其中：股票 153,774,912.84 18.60

2 固定收益投资 648,316,777.80 78.41

其中：债券 648,316,777.80 78.41

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 9,266,997.27 1.12

7 其他各项资产 15,483,797.46 1.87

8 合计 826,842,485.37 100.00

### 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 65,395,624.34 8.45

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 714,000.00 0.09

E 建筑业 2,212,399.50 0.29

F 批发和零售业 --

G 交通运输、仓储和邮政业 4,371,900.00 0.56

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 7,639.62 0.00

J 金融业 77,627,799.38 10.03

K 房地产业 --

L 租赁和商务服务业 --

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业 3,445,550.00 0.44

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 153,774,912.84 19.86

### 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 000651 格力电器 661,700 27,242,189.00 3.52

2	600104	上汽集团	700,000	21,735,000.00	2.81
3	601318	中国平安	423,400	21,004,874.00	2.71
4	002142	宁波银行	989,700	19,101,210.00	2.47
5	601601	中国太保	557,047	18,867,181.89	2.44
6	000550	江铃汽车	628,800	13,016,160.00	1.68
7	601328	交通银行	1,700,000	10,472,000.00	1.35
8	601988	中国银行	2,160,700	7,994,590.00	1.03
9	601021	春秋航空	130,000	4,371,900.00	0.56
10	000069	华侨城 A	342,500	3,445,550.00	0.44

#### 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	132,060,000.00	17.06
2	央行票据	--	--
3	金融债券	512,023,000.00	66.13
其中：政策性金融债 512,023,000.00 66.13			
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转债（可交换债）	4,233,777.80	0.55
8	同业存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	648,316,777.80	83.73

#### 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	150218	15 国开	18 3,200,000	307,680,000.00	39.74
2	019547	16 国债	19 1,500,000	132,060,000.00	17.06
3	150319	15 进出	19 1,000,000	94,030,000.00	12.14
4	160205	16 国开	05 500,000	46,585,000.00	6.02
5	160213	16 国开	13 500,000	45,350,000.00	5.86

#### 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投资。

#### 9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 11 投资组合报告附注

11.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到

公开谴责、处罚。

11.2 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。

11.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 34,596.51

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 15,449,200.95

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 15,483,797.46

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金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

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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。

### 十三、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

期间 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

2016.9.29-2016.12.31 -4.19% 0.39% 0.13% 0.32% -4.32% 0.07%

2017.1.1-2017.6.30 1.39% 0.24% 4.15% 0.24% -2.76% 0.00%

2016.9.29-2017.6.30 -2.86% 0.30% 4.29% 0.27% -7.15% 0.03%

### 十四、基金费用与税收

#### 一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券、期货交易费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、基金的账户开户费用和账户维护费；

9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E1.0\% \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E0.20\% \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

上述一、基金费用的种类中第 3—9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 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。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 十五、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 2017 年 5 月 13 日刊登的本基金原招募说明书（《博时乐臻定期开放混合型证券投资基金更新招募说明书 2017 年第 1 号》）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，对基金托管人的情况进行了更新；
- 3、在五、相关服务机构中，对相关服务机构进行了更新；
- 4、在八、基金的投资中，更新了（八）基金投资组合报告的内容，数据内容截止时间为 2017 年 6 月 30 日；

5、在九、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 2017 年 6 月 30 日；

6、在二十一、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)、2017 年 09 月 22 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时乐臻定期开放混合型证券投资基金开放转换业务的公告》；

(二)、2017 年 09 月 22 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时乐臻定期开放混合型证券投资基金开放申购、赎回业务的公告》；

(三)、2017 年 09 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《关于博时旗下部分开放式基金增加联储证券有限责任公司为代销机构的公告》；

(四)、2017 年 08 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《博时乐臻定期开放混合型证券投资基金 2017 年半年度报告（摘要）》；

(五)、2017 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《博时乐臻定期开放混合型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告》；

(六)、2017 年 06 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《关于博时旗下部分开放式基金增加首创证券股份有限公司为代销机构的公告》；

(七)、2017 年 05 月 13 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《博时乐臻定期开放混合型证券投资基金更新招募说明书 2017 年第 1 号（摘要）》；

(八)、2017 年 04 月 22 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时乐臻定期开放混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告》；

(九)、2017 年 04 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《关于博时旗下部分开放式基金增加华夏财富为代销机构的公告》；

博时基金管理有限公司

2017 年 11 月 13 日