

博时量化平衡混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

本基金根据 2016 年 12 月 8 日中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）《关于准予博时量化平衡混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]3045 号）进行募集。本基金的基金合同已于 2017 年 5 月 4 日正式生效。本基金为契约型开放式基金。

【重要提示】

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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者在申购本基金前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。

基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2017 年 11 月 4 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 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）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相关工作。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相关工作。年金投资部负责公司所管理企业年金等养老金资产的投资管理及相关工作。产品规划部负责新产品设计、新产品报批、主管部门沟通维护、产品维护以及年金方案设计等工作。互联网金融部负责公司互联网金融战略规划的设计和和实施，公司互联网金融的平台建设、业务拓展和客户运营，推动公司相关业务在互联网平台的整合与创新。客户服务中心负责零售客户的服务和咨询工作。

董事会办公室专门负责股东会、董事会、监事会及董事会各专业委员会各项会务工作；股东关系管理与董、监事的联络、沟通及服务；基金行业政策、公司治理、战略发展研究、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 9 月 30 日，公司总人数为 526 人，其中研究员和基金经理超过 86%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，1957 年生，中共党员，西南财经大学经济学博士，高级经济师。1986 年至 1992 年，任国家外汇管理局政研室副主任、计划处处长；1992 年至 2002 年，任中国人民银行海南省分行行长助理、中国人民银行海南省分行副行长兼国家外汇管理局海南分局副局长、中国人民银行广州分行副行长；2002 年 9 月至 2007 年 4 月，任广东发展银行行长；2007 年 4 月至 2015 年 7 月，历任招商银行执行董事、副行长、副董事长，期间兼任永隆银行副董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长、招商基金管理有限公司董事长、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 7 月起，任博时基金管理有

限公司第六届董事会董事长。

江向阳先生，董事。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。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。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；2015 年 7 月起，任博时基金管理有限公司总经理、第六届董事会董事。

彭磊女士，分别于 1994 年 7 月及 2010 年 7 月获得西南财经大学企业管理专业经济学学士学位，以及北京大学金融学专业经济学硕士学位。曾在不同证券和金融类公司担任管理或行政职位，拥有相关管理和从业经验。于 2002 年 5 月至 2003 年 10 月兼任友联资产管理公司执行董事。于 2002 年 5 月加入招商局金融集团有限公司，历任综合管理部副总经理、审计稽核部总经理、中国业务部总经理、证券部总经理、总经理助理。自 2011 年 6 月起担任长城证券股份有限公司董事；自 2015 年 3 月起担任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司董事；自 2016 年 4 月起担任招商局金融集团有限公司副总经理。

王金宝先生，1964 年生，硕士。1981 年至 1985 年在复旦大学数学系学习，获学士学位。1985 年至 1988 年在复旦大学数理统计系学习，获硕士学位。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，1996 年 5 月任招商证券上海澳门路营业部总经理；2001 年 9 月任招商证券上海地区总部副总经理（主持工作）；2002 年 10 月任招商证券投资部总经理；2005 年 1 月任招商证券投资部总经理兼固定收益部总经理；2005 年 8 月任招商证券股票销售交易部总经理（现更名为机构业务总部）；2008 年 4 月任招商证券机构客户业务董事总经理；2012 年 4 月任招商证券股票销售交易部联席总经理（现更名为机构业务总部）；2012 年 9 月任招商证券股票销售交易部总经理（现更名为机构业务总部）；2017 年 8 月任招商证券机构业务总部总经理兼任机构业务一部总经理。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。2016 年 1 月起，任博时基金管理有限公司第六届董事会董事。

张灏先生，1978 年生，学士。2000 年毕业于美国麻省理工学院，获得数学学士学位和经济学学士学位。2000 年起，任职于瑞士信贷（CSFB）纽约办公室并加入企业并购部门担任经理，负责全球电讯及消费零售行业的并购项目；2005 年，加入摩根大通（JPMorgan）香港办公室担任副总裁，负责大中华区的企业并购项目；2008 年，加入著名基金公司德劭集团（DEShawCo.）之大中华区私募股权投资部门担任执行董事。2013 年至今，加入上海信利股权投资基金管理有限公司担任董事及上海汇华实业有限公司担任投资总监，并负责股权投资项目管理。

顾立基先生，1948 年生，硕士。1982 年毕业于清华大学，获学士学位；1996 年毕业于中国科技大学，获工学硕士学位。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。2008 年 2 月至今，任清华大学深圳研究生院兼职教授；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。

姜立军先生，1955 年生，会计师，工商管理硕士（MBA）。1974 年 12 月参加工作，历任中国远洋运输总

公司财务处科员、中国-坦桑尼亚联合海运服务公司财务部经理、日本中铃海运服务公司财务部经理、中远（英国）公司财务部经理、香港益丰船务公司财务部经理、香港-佛罗伦租箱公司（香港上市公司）副总经理、中远太平洋有限公司（香港上市公司）副总经理、中远日本公司财务部长和营业副本部长、中远集装箱运输有限公司副总会计师等职。2002.8-2008.7，任中远航运股份有限公司（A股上市公司）首席执行官、董事。2008.8-2011.12，任中远投资（新加坡）有限公司（新加坡上市公司）总裁、董事会副主席、中远控股（新加坡）有限公司总裁；并任新加坡中资企业协会会长。2011.11-2015.12，任中国远洋控股股份有限公司执行（A+H上市公司）执行董事、总经理。2012.2-2015.12，兼任中国上市公司协会副监事长、天津上市公司协会副会长；2014.9-2015.12，兼任中国上市公司协会监事会专业委员会副主任委员。

赵如冰先生，1956年生，教授级高级工程师，国际金融专业经济学硕士研究生。历任葛洲坝水力发电厂工作助理工程师、工程师、高级工程师、葛洲坝二江电厂电气分厂主任、书记；1989.09-1991.10任葛洲坝至上海正负50万伏超高压直流输电换流站书记兼站长，主持参加了我国第一条亚洲最大的直流输电工程的安装调试和运行；1991.10-1995.12任厂办公室主任兼外事办公室主任；1995.12-1999.12，任华能南方开发公司党组书记、总经理，兼任中国华能集团董事、深圳南山热电股份有限公司（上市公司代码0037）副董事长、长城证券有限责任公司副董事长、深圳华能电讯有限公司董事长；2000.01-2004.07，华能南方公司被国家电力公司重组后，任华能房地产开发公司副总经理，长城证券有限责任公司副董事长、董事；2004.07-2009.03，任华能房地产开发公司党组书记、总经理；2009.12-2016.8，任景顺长城基金管理公司董事长、景顺长城资产管理（深圳）公司董事长；2016.8-至今，任阳光资产管理股份有限公司副董事长；兼任西南证券、百隆东方、威华股份独立董事。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。2017年6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

黄瑞庆先生，博士。2002年起先后在融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管理股份有限公司从事研究、投资、管理等工作。2013年加入博时基金管理有限公司，历任股票投资部EFT及量化组投资副总监、基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监（主持工作）、股票投资部量化投资组投资总监、博时价值增长混合基金（2015年2月9日至2016年10月24日）、博时价值增长贰号混合基金（2015年2月9日至2016年10月24日）的基金经理。现任指数与量化投资部总经理兼博时特许价值混合基金（2015年2月9日至今）、博时量化平衡混合基金（2017年5月4日）的基金经理。

林景艺女士，硕士，CFA。2010年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任量化分析师、高级研究员兼基金经理助理，现任博时国企改革股票基金（2015年5月20日至今）、兼博时量化平衡混合基金（2017年5月4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、博时新兴消费主题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 年起先后在北京无线电厂、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) 基金托管人基本情况

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：郭明

(二) 主要人员情况

截至 2017 年 6 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 218 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、基本养老保险、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 2017 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 745 只。自 2003 年以来，本行连续十四年获得香港《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 54 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）基金托管人的内部控制制度

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、2016 年中国工商银行资产托管部均通过 ISAE3402（原 SAS70）审阅，迄今已第十次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；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控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、相关信息披露中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

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。

三、相关服务机构

一、基金份额发售机构

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

窗体顶端

(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/>

(3)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/>

(4)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/>

(5)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>

(6)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>

(7)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/>

(8)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：杨明生

联系人：陈涇渭/刘伟

电话：020-38321497/020-38322566

传真：020-38321676

客户服务电话：4008308003

网址：<http://www.cgbchina.com.cn/>

(9)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.nbcb.com.cn>

(10)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/>

(11)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.bjrcb.com>

(12)青岛银行股份有限公司

注册地址: 青岛市市南区香港中路68号

办公地址: 青岛市市南区香港中路68号

法定代表人: 郭少泉

联系人: 徐伟静

电话: 0532-68629925

传真: 0532-68629939

客户服务电话: 96588(青岛) 400-669-6588(全国)

网址: <http://www.qdccb.com>

(13)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: 卢国锋

联系人: 吴照群

电话: 0769-22119061

传真: 0769-22117730

客户服务电话: 4001196228;0769-96228

网址: <http://www.dongguanbank.cn>

(14)南京银行股份有限公司

注册地址: 南京市白下区淮海路50号

办公地址: 南京市玄武区中山路288号

法定代表人: 林复

联系人: 刘晔

电话： 025—86775335
传真： 025—86775376
客户服务电话： 95302
网址： <http://www.njcb.com.cn>

(15)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>

(16)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>

(17)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/>

(18)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： 王丽辉

电话： 0311-67806407

传真： 0311-88627027

客户服务电话： 400-612-9999

网址： <http://www.hebbank.com>

(19)嘉兴银行股份有限公司

注册地址： 嘉兴市建国南路 409 号

办公地址： 嘉兴市建国南路 409 号

法定代表人： 夏林生

联系人： 顾晓光

电话： 0573-82099660

传真： 0573-82099660

客户服务电话： 0573-96528

网址： <http://www.bojx.com>

(20)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

(21)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>

(22)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/>

(23)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>

(24)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

(25)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>

(26)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

(27)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>

(28)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>

(29)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>

(30)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：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层
法定代表人：张跃伟
联系人：敖玲
电话：021-58788678-8201
传真：02158787698
客户服务电话：400-820-2899
网址：<http://www.erichfund.com>

(31)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

(32)乾道金融信息服务（北京）有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室
办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室
法定代表人：王兴吉
联系人：高雪超
电话：010-62062880
传真：010-82057741
客户服务电话：400-088-8080
网址：www.qiandaojr.com

(33)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>

(34)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>

(35)深圳盈信基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1 (811-812)

办公地址：大连市中山区南山路 155 号南山 1910 小区 A3-1

法定代表人：苗宏升

联系人：胡碧萱

电话：0411-66889888

传真：0411-66889827

客户服务电话：400-790-3688

网址：www.fundying.com

(36)一路财富（北京）信息科技股份有限公司

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>

(37)北京钱景基金销售有限公司

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

(38)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

(39)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

(40)中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址： 北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层
法定代表人：钱昊旻
联系人：孙雯
电话：010-59336533
传真：010-59336500
客户服务电话：4008909998
网址：www.jnlc.com

(41)北京电盈基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 F 座 12B
法定代表人：程刚
联系人：李丹
电话：010-56176115
传真：010-56176117
客户服务电话：010-56176115
网址：www.bjdyfund.com

(42)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/>

(43)中民财富管理（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元
办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 17 层
法定代表人：弭洪军
联系人：茅旦青
电话：021-33355392
传真：021-63353736
客户服务电话：400-876-5716
网址：www.cmiwm.com

(44)深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址： 深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼

办公地址： 深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼

法定代表人： 赖任军

联系人： 张烨

电话： 0755-66892301

传真： 0755-66892399

客户服务电话： 400-950-0888

网址： www.jfzinv.com

(45)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

(46)天津万家财富资产管理有限公司

注册地址： 天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址： 北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人： 李修辞

联系人： 孙雪

电话： 010-59013825

传真： 010-59013707

客户服务电话： 010-59013825

网址： <http://www.wanjiawealth.com/>

(47)弘业期货股份有限公司

注册地址： 南京市中华路 50 号

办公地址： 南京市中华路 50 号

法定代表人： 周剑秋

联系人： 孙朝旺

电话： 025-52278870

传真： 025-52313068
客户服务电话： 400-828-1288
网址： www.ftol.com.cn

(48)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

(49)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/>

(50)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/>

(51)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/>

(52)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/>

(53)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

(54)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.xyq.com.cn/>

(55)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： 尤习贵

联系人： 奚博宇

电话： 027-65799999

传真： 027-85481900

客户服务电话： 95579;4008-888-999

网址： <http://www.95579.com/>

(56)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>

(57)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： 天津市南开区宾水西道 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.bhjq.com>

(58)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>

(59)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： 尹旭航
电话： 010—63081493
传真： 010—63081344
客户服务电话： 95321
网址： <http://www.cindasc.com>

(60)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/>

(61)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>

(62)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>

(63)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>

(64)平安证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：广东省深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：詹露阳

联系人：郑舒丽

电话：0755—22626172

传真：0755—82400862

客户服务电话：0755-22628888

网址：<http://www.pingan.com/>

(65)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：

联系人：李荣

电话：0769-22116572

传真：0769-22115712

客户服务电话：95328

网址：<http://www.dgzq.com.cn>

(66)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>

(67)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/>

(68)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>

(69)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>

(70)中泰证券股份有限公司

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： 0531-68889357
客户服务电话： 95538
网址： <http://www.qlzq.com.cn/>

(71)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

(72)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>

(73)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>

(74)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>

(75)联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人：徐刚
联系人：陈思
电话：021-33606736
传真：021-33606760
客户服务电话：95564
网址：<http://www.lxzq.com.cn>

(76)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.gjqz.com.cn>

(77)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

(78)太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层

办公地址：北京市西城区北展北街九号华远企业号D座三单元

法定代表人：李长伟

联系人：陈征

电话：0871-68885858

传真：0871-68898100

客户服务电话：400-665-0999

网址：<http://www.tpyzq.com/>

(79)深圳前海微众银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：广东省深圳市南山区田厦国际中心36楼、37楼

法定代表人：顾敏

联系人：唐宇

电话：0755-89462525

传真：0755-86700688

客户服务电话：400-999-8877

网址：<http://www.webank.com/>

(80)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

(81)中原银行股份有限公司

注册地址：河南省郑州市郑东新区 CBD 商务外环路 23 号中科金座大厦

办公地址：河南省郑州市郑东新区 CBD 商务外环路 23 号中科金座大厦

法定代表人： 窦荣兴

联系人： 牛映雪

电话： 0371-85517710

传真： 0371-85519869

客户服务电话： 95186

网址： www.zybank.com.cn

(82)湖北银行股份有限公司

注册地址： 武汉市武昌区水果湖街中北路 86 号汉街总部国际 8 栋

办公地址： 武汉市武昌区水果湖街中北路 86 号汉街总部国际 8 栋

法定代表人： 陈大林

联系人： 李昕雅

电话： 027-87139129

传真： 027-87135931

客户服务电话： （湖北）96599（全国）400-85-96599

网址： <http://www.hubeibank.cn>

窗体底端

窗体顶端

窗体底端

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

博时量化平衡混合型证券投资基金

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

本基金采用平衡型配置，严格控制最大回撤，基于多个逻辑不同的量化择时策略，最大程度地去过滤下跌，减少回撤，力争获取长期相对稳定的收益。

七、投资范围

本基金投资于依法发行或上市的股票、（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款、国债期货以及现金，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)。

基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 0%-40%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

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

八、投资策略

本基金的量化多策略体系是在大类资产配置策略的基础之上，基于多因子模型、事件驱动类策略以及量化择时模型等多种量化策略进行择时和选股，并同时运用股指期货进行适量系统性风险对冲的绝对收益策略体系。

1、大类资产配置策略

本基金的大类资产配置策略主要是基于对宏观经济周期运行规律的研究予以决策，根据经济周期决定股票资产和债券资产的投资比例，以实现股债的平衡配置。

本基金将通过跟踪宏观经济变量（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，来判断经济周期目前的位置以及未来发展方向。在经济周期各阶段，综合对各类宏观经济指标和市场指标的分析，本基金对大类资产进行配置的策略为：在经济复苏期和繁荣期超配股票资产；在经济衰退期和政策刺激阶段，超配债券资产，力争通过资产配置获得部分超额收益。

通过股票和债券的平衡配置，并通过量化多策略体系的量化择时和量化选股策略，从而控制基金回撤风险，保证投资者无论在任何时候认购本基金，预期最大回撤不超过 10%。

2、量化择时策略

博时基金的量化多策略择时体系以择时策略的多逻辑、多期限以及多品种为目标进行设计和开发，在各品种上综合考虑基本面和市场面的择时模型，从而形成对品种的长、中、短期趋势和方向的判断。基金经理根据市场的实际情况，综合前瞻性地运用各种择时策略进行操作。具体如下图所示：

本基金在股票市场上的择时策略主要通过对股票的市场面和基本面各因素在长、中、短期上呈现出的不同规律和逻辑进行量化建模，从而形成对市场在不同期限上的判断，并指导实际操作。长期择时策略主要综合考虑基本面和市场面因素，包括利率、估值以及价格和成交量长期趋势等择时模型。市场中期方向判断主要考虑市场面因素并辅以基本面模型，包括市场资金流入流出、指数收益率变化趋势等市场面择时模型，以及全市场整体营收、利润增速等基本面模型。而短期择时策略则依靠市场面模型，包括根据价量短期趋势、价量短期形态特征捕捉市场短期动量和反转的择时模型，以及根据市场各股涨跌分布、指数价格分布等判断市场短期方向的择时模型。

3、量化选股策略

博时的量化选股策略体系包括基本面策略、市场面策略以及基本面和市场面结合的策略，各个策略自成体系，具有各自的投资逻辑和风险特征。基金经理通过考察多种市场风格的长期与短期变化趋势，动态调整市场风格的权重，根据每一个策略的风格暴露及其策略容量选择最适合当前市场风格若干个子策略进行配置。具体如下图所示：

4、其他投资策略

（1）债券投资策略

由于流动性管理及策略性投资的需要，本基金将进行国债、金融债、企业债等债券以及可转换债券的投资。债券投资策略包括利率策略、信用策略等，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。

（2）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。

（3）资产支持证券的投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同，在保证本金绝对安全和基金资产流动性基础上获得长期稳定收益。

（4）股指期货投资策略

本基金现阶段主要通过卖出股指期货合约，对冲持有股票的系统性风险。基金管理人将根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各月份期货合约之间进行动态配置，优化股指期货组合，创造额外收益。

（5）国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

（6）融资融券交易策略

本基金可通过融资融券等信用交易的杠杆作用，在符合信用交易各项法规要求及风险控制要求的前提下，放大投资收益。

未来，随着中国证券市场投资工具的发展和丰富，在符合有关法律法规规定的前提下，基金可在履行适当

程序后相应调整和更新相关投资策略。

九、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*20%+中债综合财富（总值）指数收益率*80%。

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个市场第一个统一指数；该指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，不易被操纵，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，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。

如果相关法律法规发生变化，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，经基金管理人与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无须召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。

十一、基金投资组合报告

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

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

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 27,795,544.24 35.37

其中：股票 27,795,544.24 35.37

2 固定收益投资 20,576,890.00 26.18

其中：债券 20,576,890.00 26.18

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 21,500,000.00 27.36

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 1,945,640.84 2.48

7 其他各项资产 6,776,500.79 8.62

8 合计 78,594,575.87 100.00

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 2,894,483.00 4.03

C 制造业 7,301,929.24 10.16

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 1,447,680.00 2.02

F 批发和零售业 1,529,645.00 2.13
 G 交通运输、仓储和邮政业 --
 H 住宿和餐饮业 --
 I 信息传输、软件和信息技术服务业 --
 J 金融业 12,332,705.00 17.17
 K 房地产业 1,508,050.00 2.10
 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 781,052.00 1.09
 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 27,795,544.24 38.69

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	601166	兴业银行	93,000	1,607,970.00	2.24
2	600153	建发股份	131,300	1,529,645.00	2.13
3	601668	中国建筑	156,000	1,447,680.00	2.02
4	601288	农业银行	337,800	1,290,396.00	1.80
5	000001	平安银行	103,000	1,144,330.00	1.59
6	601628	中国人寿	40,000	1,109,600.00	1.54
7	601818	光大银行	272,000	1,101,600.00	1.53
8	601939	建设银行	150,000	1,045,500.00	1.46
9	600016	民生银行	129,500	1,038,590.00	1.45
10	600000	浦发银行	78,200	1,006,434.00	1.40

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	14,992,500.00	20.87
2	央行票据	--	--
3	金融债券	--	--
其中：政策性金融债 --			
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）	5,584,390.00	7.77
8	同业存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	20,576,890.00	28.64

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	113011	光大转债	50,000	5,571,000.00	7.75
2	010107 21	国债	50,000	5,098,500.00	7.10
3	019563 17	国债 09	50,000	4,997,500.00	6.96
4	010303 03	国债	50,000	4,896,500.00	6.82
5	132012 17	巨化 EB 130	13,390.00	0.02	

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

11 投资组合报告附注

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

11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1	存出保证金	52,666.01
2	应收证券清算款	6,392,731.36
3	应收股利	-
4	应收利息	194,802.00
5	应收申购款	136,301.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,776,500.79

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	5,571,000.00	7.75

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末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 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 — —

2017.5.4-2017.9.30 7.77% 0.26% 3.73% 0.14% 4.04% 0.12%

十三、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、账户开户费用、账户维护费用；
- 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 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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、公休假等，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：

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

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—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。

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2017年3月27日刊登的本基金原招募说明书（《博时量化平衡混合型证券投资基金招募说明书》）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、在六、基金的募集与基金合同的生效中，更新了基金的成立信息；
- 5、在七、基金份额的申购与赎回中，更新了（二）申购与赎回办理的开放日及时间、（十三）基金转换、（十七）定期定额投资计划的内容；
- 6、在八、基金的投资中，更新了（七）基金投资组合报告的内容，数据内容截止时间为2017年9月30日；
- 7、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9月30日；
- 8、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）、2017年10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《博时量化平衡混合型证券投资基金2017年第3季度报告》；
 - （二）、2017年10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北京电盈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》；
 - （三）、2017年10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《关于博时旗下部分开放式基金增加广发银行股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》；
 - （四）、2017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《关于博时旗下部分开放式基金增加中民财富管理（上海）有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》；
 - （五）、2017年09月25日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加深圳盈信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》；
 - （六）、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天津万家财富管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》；
 - （七）、2017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《关于博时旗下部分开放式基金增加弘业期货股份有限公司为代销机构的公告》；
 - （八）、2017年08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《关于博时旗下部分开放式基金增加乾道金融信息服务（北京）有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》；
 - （九）、2017年08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湖北银行股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》；
 - （十）、2017年07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《关于博时旗下部分基金继续参加交通银行网上银行申购业务费率优惠活动的公告》、《关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购及定投业务费率优惠活动的公告》；
 - （十一）、2017年06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增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》；
 - （十二）、2017年06月05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博时量化平衡混合型证券投资基金参加部分代销机构费率优惠活动的公告》、《关于博时量

化平衡混合型证券投资基金新增大连网金金融信息服务有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》
；

(十三)、2017年06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《博时量化平衡混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》、《博时量化平衡混合型证券投资基金开放日常转换、定期定额投资业务的公告》；

(十四)、2017年05月05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《博时量化平衡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12月19日