

# 博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置 混合型证券投资基金 更新招募说明书

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

## 【重要提示】

本基金经中国证监会2019年06月05日证监许可[2019]1015号文注册募集。

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价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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，投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，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，封闭运作期届满后由于基金投资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基金管理风险等。

本基金基金合同生效后进入三年的封闭运作期，封闭运作期间投资者不能申购、赎回基金份额。本基金在封闭运作期间，基金份额可上市交易，投资者可在二级市场买卖基金份额。受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。

本基金以投资科创主题战略配售股票为主要投资策略，需参与并接受科创板发行人的战略配售股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。

本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节等。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。投资有风险，投资人申购基金时，应认真阅读本招募说明书，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。在本基金存续期间，基金管理人不承担基金销售、基金投资等运作环节中的任何汇率变动风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》、《基金合同》及基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现；基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“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，由投资人自行承担。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

本招募说明书（更新）所载内容截止日 2020 年 10 月 14 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2020 年 06 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 目录

【重要提示】.....	2
第一部分 绪言.....	5
第二部分 释义.....	6
第三部分 基金管理人.....	11
第四部分 基金托管人.....	25
第五部分 相关服务机构.....	29
第六部分 基金的募集与基金合同的生效.....	59
第七部分 基金份额的上市交易.....	60
第八部分 基金份额的申购与赎回.....	61
第九部分 基金的投资.....	72
第十部分 基金的业绩.....	95
第十一部分 基金的财产.....	96
第十二部分 基金资产的估值.....	97
第十三部分 基金的收益分配.....	103
第十四部分 基金的费用与税收.....	105
第十五部分 基金的会计与审计.....	108
第十六部分 基金的信息披露.....	109
第十七部分 风险揭示.....	116
第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	126
第十九部分 基金合同的内容摘要.....	128
第二十部分 基金托管协议的内容摘要.....	155
第二十一部分 对基金份额持有人的服务.....	176
第二十二部分 其他应披露的事项.....	179
第二十三部分 招募说明书存放及查阅方式.....	181
第二十四部分 备查文件.....	182

## 第一部分 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）以及《博时科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、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基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同、招募说明书的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指博时基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国工商银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、《上市交易公告书》：指《博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金上市交易公告书》
- 10、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 11、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

14、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

15、《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

18、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

19、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

20、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

21、特定机构投资者：指全国社会保障基金、基本养老保险基金、企业年金基金和职业年金基金等机构投资者

22、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

23、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

24、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者（含特定机构投资者）、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

25、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

26、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

27、销售机构：指博时基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构，以及可通过上海证券交易所办理基金销售业务的会员单位。其中，可通过上海证



券交易所办理本基金销售业务的机构必须是具有基金销售业务资格、并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位

8、场外：指通过上海证券交易所外的销售机构进行基金份额认购、申购和赎回等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回

29、场内：指通过上海证券交易所内具有基金销售业务资格的会员单位通过上海证券交易所开放式基金销售系统进行基金份额认购、申购、赎回以及上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回

30、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

31、登记机构：指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

32、登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统。投资人通过场外基金销售机构认购、申购所得的基金份额登记在本系统下

33、证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记结算系统。投资人通过场内会员单位认购、申购或买入所得的基金份额登记在本系统下

34、开放式基金账户：指投资人通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，用于记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

35、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

36、上海证券账户：指投资人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开立的上海证券交易所人民币普通股票账户（即 A 股账户）或证券投资基金账户

37、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

38、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期



39、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

40、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

41、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所及相关期货交易所的正常交易日

42、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

43、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)，n 为自然数

44、封闭运作期：基金合同生效后的前三年为封闭运作期，封闭运作期内本基金不开放申购、赎回。封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF）

45、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（封闭运作期届满后，若基金投资港股通标的股票且该工作日为非港股通交易日，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回或其他业务，具体以届时提前发布的公告为准）

46、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

47、《业务规则》：指博时基金管理有限公司、上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司及销售机构的相关业务规则及对其不时做出的修订

48、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

49、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

50、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

51、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

52、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作，包括系统内转托管和跨系统转托管

53、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

54、巨额赎回：指本基金封闭运作期届满，转为上市开放式基金（LOF）后，单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 %

55、元：指人民币元

56、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等，法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定

57、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

58、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

59、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

60、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

61、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

62、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

63、港股通标的股票：指内地投资者委托内地证券公司，经由境内证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

64、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

65、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

以上释义中涉及法律法规、业务规则的内容，法律法规、业务规则修订后，如适用本基金，相关内容以修订后法律法规、业务规则为准。

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称： 博时基金管理有限公司

住所： 深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层

办公地址： 广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层

法定代表人： 江向阳

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三十一一个直属部门，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、多元资产管理部、年金投资部、绝对收益投资部、产品规划部、销售管理部、客户服务中心、市场部、养老金业务中心、战略客户部、机构-北京、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、零售-西部、央企业务部、互联网金融部、财富管理部、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）、特定资产管理部、研究部。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。特定资产管理部负责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。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、指数与创新组、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。

市场部负责市场竞争分析、市场政策拟订；组织落实公司总体市场战略，协同产品和投资体系以及市场团队的协同；拟订年度市场计划和费用预算，具体负责机构业务的绩效考核和费用管理；公司品牌及产品传播；机构产品营销组织、市场分析等工作。战略客户部集中服务国有银行、政策性银行、大型头部保险公司、中央汇金公司等重要金融机构。机构-北京负责北方地区其他银行、保险和财务公司等机构业务。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、大宗交易业务、融券业务、做市商业务、股指期货业务等工作。零售-北京、零售-上海、零售-南方、零售-西部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。销售管理部负责总行渠道维护，零售产品营销组织、销售督导；营销策划及公募销售支持；营销培训管理；渠道代销支持与服务；零售体系的绩效考核与费用管理等工作。

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。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。绝对收益投资部负责公司绝对收益产品的研究和投资管理工作。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、重要政府部门、监管部门以及交易所、外汇交易中心等证券市场重要主体的关系维护等工作。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。财富管理部负责高端客户的理财服务与销售。客户服务中心负责电话与网络咨询与服务；呼出业务与电话营销理财；营销系统数据维护与挖掘；直销柜台业务；专户合同及备案管理、机构售前支持；专户中台服务与运营支持等工作。

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。

另设北京分公司和上海分公司,分别负责对驻京、沪人员日常行政管理和对赴京、沪、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 2020 年 6 月 30 日,公司总人数为 616 人,其中研究员和基金经理超过 90%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

江向阳先生,博士。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。自 2020 年 1 月 9 日起代为履行博时基金董事长职务。自 2020 年 4 月 15 日起任博时基金管理有限公司董事长。



苏敏女士, 分别于1990年7月及2002年12月获得上海财经大学金融专业学士学位和中国科学技术大学工商管理硕士学位。苏女士分别于1998年6月、1999年6月及2008年6月获中国注册会计师协会授予的注册会计师资格、中国资产评估协会授予的注册资产评估师资格及安徽省人力资源和社会保障厅授予的高级会计师职称。苏女士拥有管理金融类公司及上市公司的经验, 其经验包括: 自2015年9月及2015年12月起任招商局金融集团有限公司总经理及董事; 自2016年6月起任招商证券股份有限公司(上海证券交易所上市公司, 股票代码: 600999; 香港联交所上市公司, 股票代码: 6099) 董事; 自2014年9月起担任招商银行股份有限公司(上海证券交易所上市公司, 股票代码: 600036; 香港联交所上市公司, 股票代码: 3968) 董事。自2016年1月至2018年8月任招商局资本投资有限责任公司监事; 自2015年11月至2018年8月任招商局创新投资管理有限公司董事; 自2015年11月至2017年4月任深圳招商启航互联网投资管理有限公司董事长; 自2013年5月至2015年8月任中远海运能源运输股份有限公司(上海证券交易所上市公司, 股票代码: 600026; 香港联交所上市公司, 股票代码: 1138) 董事; 自2013年6月至2015年12月任中远海运发展股份有限公司(上海证券交易所上市公司, 股票代码: 601866; 香港联交所上市公司, 股票代码: 2866) 董事; 自2009年12月至2011年5月担任徽商银行股份有限公司(香港联交所上市公司, 股票代码: 3698) 董事; 自2008年3月至2011年9月担任安徽省皖能股份有限公司(深圳证券交易所上市公司, 股票代码: 000543) 董事。苏女士亦拥有会计等相关管理经验, 其经验包括: 自2011年3月至2015年8月担任中国海运(集团)总公司总会计师; 自2007年5月至2011年4月担任安徽省能源集团有限公司总会计师, 并于2010年11月至2011年4月担任该公司副总经理。2018年9月3日起, 任博时基金管理有限公司第七届董事会董事。

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。

方瓯华先生：硕士，中级经济师。2009年起，加入交通银行，历任交行上海分行市南支行、大客户二部、授信部、宝山支行行长助理等职位，主要负责营运及个人金融业务。2011年起，调入交通银行投资部，担任高级经理，负责交行对外战略投资及对下属子公司股权管理工作。2015年，加入上海信利股权投资基金管理有限公司并工作至今，历任高级投资经理、总经理、董事等职，同时兼任上海汇华实业有限公司总经理，负责公司整体运营。2018年9月起，担任上海盛业股权投资有限公司法定代表人及执行董事。2018年10月25日起，任博时基金管理有限公司第七届董事会董事。

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。

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

何敏女士，1975 年出生，中南财经大学会计学硕士。1999 年 7 月至 2006 年 4 月任招商证券股份有限公司财务部会计核算岗，2006 年 4 月至 2009 年 4 月任招商证券股份有限公司财务部总经理助理，2009 年 4 月至 2019 年 2 月任招商证券股份有限公司财务部副总经理，2019 年 2 月至今任招商证券股份有限公司财务部总经理。2019 年 4 月 10 日起，任博时基金管理有限公司监事会监事长。

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公司董事总经理兼人力资源部总经理。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、固定收益总部董事总经理、年金投资部总经理。现任公司总经理助理兼社保组合投资经理、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

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。现任公司副总经理兼首席信息官，主管 IT、运作、指数与量化投资、养老金等工作，兼任博时基金（国际）有限公司及博时资本管理有限公司董事。

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的工作。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首席固定收益投资官、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)有限公司董事会主席。

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

曾鹏先生，硕士。2005 年起先后在上投摩根基金、嘉实基金从事研究、投资工作。2012 年加入博时基金管理有限公司。历任投资经理、博时灵活配置混合型证券投资基金(2015 年 2 月 9 日-2016 年 4 月 25 日)基金经理。现任权益投资总部一体化投研总监兼权益投资主题组负责人、博时新兴成长混合型证券投资基金(2013 年 1 月 18 日一至今)、博时特许价值混合型证券投资基金(2018 年 6 月 21 日一至今)、博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(2019 年 6 月 27 日一至今)、博时科技创新混合型证券投资基金(2020 年 4 月 15 日一至今)的基金经理。

肖瑾先生，硕士。2012 年从复旦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、高级研究员、高级研究员兼基金经理助理、资深研究员兼基金经理助理、博时灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 8 月 1 日-2018 年 3 月 9 日)、博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 1 月 5 日-2019 年 6 月 21 日)的基金经理。现任博时回报灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 8 月 14 日一至今)、博时特许价值混合型证券投资基金(2018 年 6 月 21 日一至今)、博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(2019 年 6 月 27 日一至今)、博时汇悦回报混合型证券投资基金(2020 年 2 月 20 日一至今)、博时科技创新混合型证券投资基金(2020 年 4 月 15 日一至今)、博时科创板三年定期开放混合型证券投资基金(2020 年 7 月 29 日一至今)、博时创业板两年定期开放混合型证券投资基金(2020 年 9 月 3 日一至今)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、张龙、魏凤春、王俊、过钧、黄瑞庆、曾鹏

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。

张龙先生，硕士。1996年起先后在长江证券、长盛基金、华夏基金、北京金百朋投资管理有限公司工作。2019年加入博时基金管理有限公司，现任公司投资决策委员会专职委员兼股票投资部总经理。

魏凤春先生，博士。1993年起先后在山东经济学院、江南信托、清华大学、江南证券、中信建投证券工作。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证券投资基金(2015年8月24日-2016年12月19日)、博时平衡配置混合型证券投资基金(2015年11月30日-2016年12月19日)的基金经理、多元资产管理部总经理、博时颐泽稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)(2019年3月20日—2020年9月3日)、博时颐泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)(2019年8月28日—2020年9月3日)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。

王俊先生，硕士。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(2015.5.20-2016.6.8)、博时丝路主题股票基金(2015.5.22-2016.6.8)、博时沪港深价值优选混合基金(2017.1.25-2018.3.14)、博时沪港深成长企业混合基金(2016.11.9-2019.6.10)的基金经理、研究部总经理。现任研究部研究总监兼博时主题行业混合(LOF)基金(2015.1.22-至今)、博时沪港深优质企业混合基金(2016.11.9-至今)、博时新兴消费主题混合基金(2017.6.5-至今)、博时优势企业混合基金(2019.6.3-至今)、博时研究优选混合基金(2020.3.20-至今)、博时研究精选持有期混合基金(2020.6.24-至今)、博时研究臻选持有期混合基金(2020.6.30-至今)、博时价值臻选持有期混合基金(2020.7.29-至今)的基金经理。

过钧先生，硕士。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(2005.8.24-2010.8.4)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(2010.11.24-2013.9.25)、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金(2013.2.1-2014.4.2)、博时裕祥分级债券型证券投资基金(2014.1.8-2014.6.10)、博时双债增强债券型证券投资基金(2013.9.13-2015.7.16)、博时新财富混合型证券投资基金(2015.6.24-2016.7.4)、博时新机遇混合型证券投资基金(2016.3.29-2018.2.6)、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金(2016.8.1-2018.2.6)、博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)

(2014. 6. 10-2018. 4. 23)、博时双债增强债券型证券投资基金(2016. 10. 24-2018. 5. 5)、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金(2017. 2. 10-2018. 5. 21)、博时鑫和灵活配置混合型证券投资基金(2017. 12. 13-2018. 6. 16)、博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金(2017. 1. 10-2018. 7. 30)的基金经理、固定收益总部公募基金组负责人、博时新价值灵活配置混合型证券投资基金(2016. 3. 29-2019. 4. 30)、博时乐臻定期开放混合型证券投资基金(2016. 9. 29-2019. 10. 14)、博时转债增强债券型证券投资基金(2019. 1. 28-2020. 4. 3)、博时鑫源灵活配置混合型证券投资基金(2016. 9. 6-2020. 7. 20)、博时新起点灵活配置混合型证券投资基金(2016. 10. 17-2020. 7. 20)、博时鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金(2017. 2. 10-2020. 7. 20)的基金经理。现任公司董事总经理兼固定收益总部指数与创新组负责人、博时信用债券投资基金(2009. 6. 10-至今)、博时新收益灵活配置混合型证券投资基金(2016. 2. 29-至今)、博时中债 3-5 年进出口行债券指数证券投资基金(2018. 12. 25-至今)、博时中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金(2019. 7. 19-至今)的基金经理。

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 ETF 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. 2. 9-2016. 10. 24)、博时价值增长贰号混合基金(2015. 2. 9-2016. 10. 24)、博时特许价值混合基金(2015. 2. 9-2018. 6. 21)的基金经理。现任指数与量化投资部总经理兼博时量化平衡混合基金(2017. 5. 4-至今)、博时量化多策略股票基金(2018. 4. 3-至今)、博时量化价值股票基金(2018. 6. 26-至今)的基金经理。

曾鹏先生, 硕士。2005 年起先后在上投摩根基金、嘉实基金从事研究、投资工作。2012 年加入博时基金管理有限公司。历任投资经理、博时灵活配置混合型证券投资基金(2015 年 2 月 9 日-2016 年 4 月 25 日)基金经理。现任权益投资总部一体化投研总监兼权益投资主题组负责人、博时新兴成长混合型证券投资基金(2013 年 1 月 18 日一至今)、博时特许价值混合型证券投资基金(2018 年 6 月 21 日一至今)、博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(2019 年 6 月 27 日一至今)、博时科技创新混合型证券投资基金(2020 年 4 月 15 日一至今)的基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责



- (1) 依法募集资金，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) 对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- (4) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- (5) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (6) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
- (7) 计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- (8) 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- (9) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (10) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (11) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (12) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他职责。

#### 四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

- 1、基金管理人承诺遵守《基金法》及其他相关法律法规的规定，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》及其他相关法律法规行为的发生。
- 2、基金管理人承诺不从事下列行为：
  - (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) 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的人牟取利益；
  - (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
  - (5) 侵占、挪用基金财产；
  - (6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
  - (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
  - (8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

#### 五、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、违反规定向他人贷款或者提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、向基金管理人、基金托管人出资；
- 5、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 6、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## 六、基金经理承诺

- 1、依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着勤勉尽责的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- 2、不能利用职务之便为自己、受雇人或基金份额持有人以外的人谋取利益；
- 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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- 4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 七、基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制制度概述

为了保证公司规范运作，有效地防范和化解管理风险、经营风险以及操作风险，确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整，从而最大程度地保护基金份额持有人的利益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是对各项基本管理制度的总揽和指导，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等的具体说明。



## 2、内部控制原则

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

独立性原则。公司各机构、部门和岗位在职能上应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡，并通过切实可行的措施来实行。

成本效益原则。公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性，运用科学化的方法尽量降低经营运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## 3、主要内部控制制度

### （1）内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

### （2）风险管理控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定，风险控制制度由风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险控制的具体制度、风险控制制度执行情况的监督等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度、信息技术系统风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、反馈制度、保密制度等程序性风险管理制度。

### （3）监察稽核制度

公司设立督察长，负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长由总经理提名，董事会聘任，并经全体独立董事同意。

督察长负责组织指导公司监察稽核工作。除应当回避的情况外，督察长享有充分的知情权和独立的调查权。督察长根据履行职责的需要，有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议，有权调阅公司相关文件、档案。督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告，并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和工作流程。

监察稽核制度包括内部稽核管理办法、内部稽核工作准则等。通过这些制度的建立，检查公司各业务部门和人员遵守有关法律、法规和规章的情况；检查公司各业务部门和人员执行公司内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

## 第四部分 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：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至 2020 年 6 月，中国工商银行资产托管部共有员工 212 人，平均年龄 33 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 2020 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1094 只。自 2003 年以来，本行连续十七年获得香港《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 73 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。从 2005 年至今共十三次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。”

### 1、内部风险控制目标

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

### 2、内部风险控制组织结构

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

### 3、内部风险控制原则

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

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

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

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

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

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、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。



## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、直销机构

名称：博时基金管理有限公司北京直销中心

住所：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层

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、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：	陈四清
联系人：	杨菲
传真：	010-66107914
客户服务电话：	95588
网址：	<a href="http://www.icbc.com.cn/">http://www.icbc.com.cn/</a>

##### (2) 中国农业银行股份有限公司

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

##### (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：	刘连舸
联系人：	高越
电话：	010-66594973
客户服务电话：	95566
网址：	<a href="http://www.boc.cn/">http://www.boc.cn/</a>

##### (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:	田国立
联系人:	张静
传真:	010-66275654
客户服务电话:	95533
网址:	<a href="http://www.ccb.com/">http://www.ccb.com/</a>

**(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:	任德奇
联系人:	陈旭
电话:	021-58781234
传真:	021-58408483
客户服务电话:	95559
网址:	<a href="http://www.bankcomm.com/">http://www.bankcomm.com/</a>

**(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
电话:	0755-83198888
传真:	0755-83195049
客户服务电话:	95555
网址:	<a href="http://www.cmbchina.com/">http://www.cmbchina.com/</a>

**(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:	王晓琳
电话:	010-89937325
客户服务电话:	95558
网址:	<a href="http://bank.ecitic.com/">http://bank.ecitic.com/</a>

**(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:	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:	<a href="http://www.spdb.com.cn">http://www.spdb.com.cn</a>
-----	---

**(9) 兴业银行股份有限公司**

注册地址:	福州市湖东路 154 号
办公地址:	上海市江宁路 168 号
法定代表人:	高建平
联系人:	曾鸣
电话:	021-52629999
客户服务电话:	95561
网址:	<a href="http://www.cib.com.cn">www.cib.com.cn</a>

**(10) 中国光大银行股份有限公司**

注册地址:	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
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:	李晓鹏
联系人:	朱红
电话:	010-63636153
传真:	010-63636157
客户服务电话:	95595
网址:	<a href="http://www.cebbank.com">http://www.cebbank.com</a>

**(11) 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:	<a href="http://www.cmbc.com.cn/">http://www.cmbc.com.cn/</a>

**(12) 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:	张金良
联系人:	陈春林
传真:	010-68858117
客户服务电话:	95580
网址:	<a href="http://www.psbc.com">http://www.psbc.com</a>

**(13) 北京银行股份有限公司**

注册地址:	北京市西城区金融大街甲 17 号首层
办公地址:	北京市西城区金融大街丙 17 号
法定代表人:	张东宁
联系人:	周黎

传真:	010-66226045
客户服务电话:	95526
网址:	<a href="http://www.bankofbeijing.com.cn/">http://www.bankofbeijing.com.cn/</a>

**(14) 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:	<a href="http://www.bosc.cn">www.bosc.cn</a>

**(15) 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:	王滨
联系人:	陈泾渭/刘伟
电话:	020-38321497/020-38322566
传真:	020-38321676
客户服务电话:	4008308003
网址:	<a href="http://www.cgbchina.com.cn/">http://www.cgbchina.com.cn/</a>

**(16) 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:	<a href="http://bank.pingan.com">http://bank.pingan.com</a>

**(17) 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:	<a href="http://www.nbc.com.cn">http://www.nbc.com.cn</a>

**(18) 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:	<a href="http://www.srcb.com/">http://www.srcb.com/</a>

**(19) 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:	<a href="http://www.qdccb.com">http://www.qdccb.com</a>

**(20) 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:	<a href="http://www.dongguanbank.cn">http://www.dongguanbank.cn</a>

**(21) 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:	<a href="http://www.njcb.com.cn">http://www.njcb.com.cn</a>

**(22) 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:	<a href="http://www.jsbchina.cn">http://www.jsbchina.cn</a>

**(23) 浙江民泰商业银行股份有限公司**

注册地址:	浙江省温岭市太平街道三星大道 168 号
办公地址:	浙江省杭州市江干区丹桂街 8 号汉嘉国际 401 室
法定代表人:	江建法
联系人:	沈斯诺
客户服务电话:	95343
网址:	<a href="http://www.mintaibank.com">www.mintaibank.com</a>

**(24) 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:	<a href="http://www.drcbank.com/">http://www.drcbank.com/</a>

**(25) 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:	<a href="http://www.suzhoubank.com">www.suzhoubank.com</a>

**(26) 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:	北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 6 层
法定代表人:	马勇
联系人:	张燕
电话:	010-58325388
传真:	010-58325300
客户服务电话:	400-166-1188
网址:	<a href="http://8.jrj.com.cn/">http://8.jrj.com.cn/</a>

**(27) 上海挖财金融信息服务有限公司**

注册地址:	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼 01、
-------	---------------------------------

	02、03室
办公地址:	上海市浦东新区杨高南路799号陆家嘴世纪金融广场3号楼5层01、02、03室
法定代表人:	胡燕亮
联系人:	陈璐
电话:	021-50810687
传真:	021-58300279
客户服务电话:	021-50810673
网址:	<a href="http://wacaijijin.com/">http://wacaijijin.com/</a>

**(28) 腾安基金销售(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:	深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15层
法定代表人:	刘明军
联系人:	谭广锋
传真:	0755-86013399
客户服务电话:	95017(拨通后转1再转8)
网址:	<a href="https://www.txfund.com/">https://www.txfund.com/</a>

**(29) 北京度小满基金销售有限公司**

注册地址:	北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室
办公地址:	北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼
法定代表人:	葛新
联系人:	孙博超
电话:	010-59403028
传真:	010-59403027
客户服务电话:	95055-4
网址:	<a href="http://www.baiyingfund.com">www.baiyingfund.com</a>

**(30) 诺亚正行基金销售有限公司**

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:	<a href="http://www.noah-fund.com">http://www.noah-fund.com</a>

**(31) 深圳众禄基金销售股份有限公司**

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:	<a href="https://www.zlfund.cn/">https://www.zlfund.cn/</a>

**(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:	<a href="http://www.1234567.com.cn">http://www.1234567.com.cn</a>

**(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:	<a href="http://www.howbuy.com">http://www.howbuy.com</a>

**(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:	<a href="http://www.fund123.cn">http://www.fund123.cn</a>

**(35) 上海长量基金销售有限公司**

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:	021-58787698
客户服务电话:	400-820-2899



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

**(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:	<a href="http://www.5ifund.com">www.5ifund.com</a>

**(37) 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:	李兴春
联系人:	徐鹏
电话:	021-50583533
传真:	021-50583633
客户服务电话:	400-921-7755
网址:	<a href="http://a.leadfund.com.cn/">http://a.leadfund.com.cn/</a>

**(38) 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:	北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼11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:	<a href="http://www.harvestwm.cn">www.harvestwm.cn</a>

**(39) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司**

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:	戎兵
联系人:	程刚
电话:	010-52855713
传真:	010-85894285
客户服务电话:	400-609-9200
网址:	<a href="http://www.yixinfund.com">http://www.yixinfund.com</a>

**(40) 南京苏宁基金销售有限公司**

注册地址:	南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:	南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:	钱燕飞
联系人:	喻明明
电话:	025-66996699-884131
传真:	025-66996699-884131
客户服务电话:	95177
网址:	www.snjijin.com

**(41) 浦领基金销售有限公司**

注册地址:	北京市朝阳区望京东园四区2号楼10层1001号04室
办公地址:	北京市朝阳区望京中航资本大厦10层
法定代表人:	聂婉君
联系人:	李艳
电话:	010-59497361
传真:	010-64788016
客户服务电话:	400-012-5899
网址:	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

**(44) 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:	400-8980-618
网址:	www.chtwm.com

**(45) 北京汇成基金销售有限公司**

注册地址:	北京市西城区西直门外大街1号院2号楼(西环广场T2)19层19C13
办公地址:	北京市西城区西直门外大街1号院2号楼(西环广场T2)19层19C13
法定代表人:	王伟刚
联系人:	丁向坤
电话:	010-56282140
传真:	010-62680827
客户服务电话:	400-619-9059
网址:	www.hcjjjin.com

**(46) 一路财富(北京)基金销售股份有限公司**

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

**(47) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司**

注册地址:	北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址:	北京市朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦A303
法定代表人:	张冠宇
联系人:	周君
电话:	010-53570568
传真:	010-59200800
客户服务电话:	400-819-9868
网址:	http://www.tdyhfund.com

**(48) 北京植信基金销售有限公司**

注册地址:	北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106-67
办公地址:	北京市朝阳区建华南路6号 卓明大厦2层
法定代表人:	于龙
联系人:	叶航

电话:	010-65166112
传真:	010-65166001
客户服务电话:	4006-802-123
网址:	<a href="http://www.zhixin-inv.com">http://www.zhixin-inv.com</a>

**(49)海银基金销售有限公司**

注册地址:	中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室
办公地址:	上海市浦东新区银城中路8号4楼
法定代表人:	巩巧丽
联系人:	毛林
电话:	021-80133597
传真:	021-80133413
客户服务电话:	400-808-1016
网址:	<a href="http://www.fundhaiyin.com">www.fundhaiyin.com</a>

**(50)济安财富(北京)基金销售有限公司**

注册地址:	北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
办公地址:	北京市朝阳区东三环中路7号财富中心A座46层
法定代表人:	杨健
联系人:	李海燕
电话:	010-65309516
传真:	010-65330699
客户服务电话:	400-673-7010
网址:	<a href="http://www.jianfortune.com">www.jianfortune.com</a>

**(51)上海万得基金销售有限公司**

注册地址:	中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:	上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人:	王廷富
联系人:	姜吉灵
电话:	021-5132 7185
传真:	021-6888 2281
客户服务电话:	400-821-0203
网址:	<a href="http://www.520fund.com.cn">www.520fund.com.cn</a>

**(52)凤凰金信(海口)基金销售有限公司**

注册地址:	宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402
办公地址:	北京市朝阳区紫月路18号院 朝来高科技产业园18号楼
法定代表人:	程刚
联系人:	张旭
电话:	010-58160168
传真:	010-58160173

客户服务电话:	400-810-5919
网址:	www.fengfd.com

**(53) 上海联泰基金销售有限公司**

注册地址:	中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:	上海市长宁区福泉北路518号8座3层
法定代表人:	燕斌
联系人:	兰敏
电话:	021-52822063
传真:	021-52975270
客户服务电话:	400-166-6788
网址:	www.66zichan.com

**(54) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司**

注册地址:	辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址:	辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:	李春光
联系人:	张晓辉
电话:	0411-88891212-327
传真:	0411-84396536
客户服务电话:	400-0411-001
网址:	www.haojiyoujijin.com

**(55) 上海基煜基金销售有限公司**

注册地址:	上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济展发区）
办公地址:	上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人:	王翔
联系人:	蓝杰
电话:	021-65370077
传真:	021-55085991
客户服务电话:	400-820-5369
网址:	www.jiyufund.com.cn

**(56) 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

**(57) 北京虹点基金销售有限公司**

注册地址:	北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603
办公地址:	北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层
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

**(58) 上海陆金所基金销售有限公司**

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

**(59) 珠海盈米基金销售有限公司**

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

**(60) 奕丰基金销售有限公司**

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

**(61) 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:	010-59336519
传真:	010-59336500
客户服务电话:	400-890-9998
网址:	www.jnlc.com

**(62)北京肯特瑞基金销售有限公司**

注册地址:	北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址:	北京市经济开发区科创十一街18号院京东总部A座4层A428室
法定代表人:	江卉
联系人:	徐伯宇
电话:	400-098-8511
传真:	010-89188000
客户服务电话:	400-088-8816
网址:	http://jr.jd.com/

**(63)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技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108
办公地址:	深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108
法定代表人:	赖任军
联系人:	刘昕霞
电话:	0755-29330513
传真:	0755-26920530
客户服务电话:	400-930-0660
网址:	www.jfzinv.com

**(64)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

**(65) 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:	<a href="http://www.wanjiawealth.com/">http://www.wanjiawealth.com/</a>

**(66) 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:	刘宏莹
电话:	010-60833754
传真:	021-60819988
客户服务电话:	400-990-8826
网址:	<a href="http://www.citicsf.com">www.citicsf.com</a>

**(67) 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:	<a href="http://www.ftol.com.cn">www.ftol.com.cn</a>

**(68) 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:	上海市静安区新闻路669号博华广场21层
法定代表人:	贺青
联系人:	钟伟镇
电话:	021-38676666
传真:	021-38670666
客户服务电话:	95521/4008888666
网址:	<a href="https://www.gtja.com">https://www.gtja.com</a>

**(69) 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:	刘畅
电话:	010-65608231
传真:	010-65182261
客户服务电话:	4008888108/95587
网址:	<a href="http://www.csc108.com/">http://www.csc108.com/</a>

**(70) 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:	李颖
电话:	0755-82130833
传真:	0755-82133952
客户服务电话:	95536
网址:	<a href="http://www.guosen.com.cn/">http://www.guosen.com.cn/</a>

**(71) 招商证券股份有限公司**

注册地址:	深圳市福田区福田街道福华一路111号
办公地址:	深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦23楼
法定代表人:	霍达
联系人:	黄婵君
电话:	0755-82943666
传真:	0755-83734343
客户服务电话:	4008888111; 95565
网址:	<a href="http://www.newone.com.cn/">http://www.newone.com.cn/</a>

**(72) 广发证券股份有限公司**

注册地址:	广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址:	广州市天河区马场路26号广发证券大厦
法定代表人:	孙树明
联系人:	黄岚
电话:	020-87555888
传真:	020-87555305
客户服务电话:	95575、020-95575 或致电各地营业网点
网址:	<a href="http://www.gf.com.cn/">http://www.gf.com.cn/</a>

**(73) 中信证券股份有限公司**

注册地址:	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
-------	-----------------------------

办公地址:	北京朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人:	张佑君
联系人:	马静懿
电话:	010-60833889
传真:	010-84865560
客户服务电话:	400-889-5548/95548
网址:	<a href="http://www.cs.ecitic.com/">http://www.cs.ecitic.com/</a>

**(74) 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:	陈共炎
联系人:	辛国政
电话:	010-83574507
传真:	010-66568990
客户服务电话:	95551/4008888888
网址:	<a href="http://www.chinastock.com.cn/">http://www.chinastock.com.cn/</a>

**(75) 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:	周杰
联系人:	李笑鸣
电话:	021-23219275
传真:	021-63602722
客户服务电话:	95553
网址:	<a href="http://www.htsec.com/">http://www.htsec.com/</a>

**(76) 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:	杨玉成
联系人:	余敏
电话:	021-33388252
传真:	021-33388224
客户服务电话:	95523 或 4008895523
网址:	<a href="http://www.swhysc.com">www.swhysc.com</a>

**(77) 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:	李新华
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:	<a href="http://www.95579.com/">http://www.95579.com/</a>

**(78) 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:	黄炎勋
联系人:	刘志斌
电话:	0755-82558323
传真:	0755-82558355
客户服务电话:	95517, 4008001001
网址:	<a href="http://www.essence.com.cn">http://www.essence.com.cn</a>

**(79) 西南证券股份有限公司**

注册地址:	重庆市江北区桥北苑 8 号
办公地址:	重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦
法定代表人:	廖庆轩
联系人:	周青
电话:	023-67616310
传真:	023-63786212
客户服务电话:	4008096096
网址:	<a href="http://www.swsc.com.cn">http://www.swsc.com.cn</a>

**(80) 湘财证券股份有限公司**

注册地址:	湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼
办公地址:	湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼
法定代表人:	孙永祥
联系人:	江恩前
电话:	021-38784580-8920
客户服务电话:	95351
网址:	<a href="http://www.xcsc.com">http://www.xcsc.com</a>

**(81) 万联证券股份有限公司**

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:	罗钦城
联系人:	甘蕾

电话:	020-38286026
传真:	020-22373718-1013
客户服务电话:	4008888133
网址:	<a href="http://www.wlzq.cn">http://www.wlzq.cn</a>

**(82) 民生证券股份有限公司**

注册地址:	北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
办公地址:	北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
法定代表人:	余政
联系人:	赵明
电话:	010-85127622
传真:	010-85127917
客户服务电话:	4006198888
网址:	<a href="http://www.msizq.com">www.msizq.com</a>

**(83) 国元证券股份有限公司**

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

**(84) 渤海证券股份有限公司**

注册地址:	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:	天津市南开区滨水西道8号
法定代表人:	安志勇
联系人:	华秋杨
电话:	022-23861692
传真:	022-28451892
客户服务电话:	4006515988
网址:	<a href="http://www.ewww.com.cn">http://www.ewww.com.cn</a>

**(85) 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:	张伟
联系人:	胡子豪
电话:	021-50531281



传真:	0755-82492962 (深圳)
客户服务电话:	95597
网址:	<a href="http://www.htsc.com.cn/">http://www.htsc.com.cn/</a>

**(86) 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:	青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东2、5层
法定代表人:	姜晓林
联系人:	孙秋月
电话:	0532-85022026
传真:	0532-85022605
客户服务电话:	95548
网址:	<a href="http://www.cs.ecitic.com/newsite/">http://www.cs.ecitic.com/newsite/</a>

**(87) 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:	魏庆华
联系人:	和志鹏
电话:	18010159340
传真:	010-66555246
客户服务电话:	4008888993
网址:	<a href="http://www.dxzq.net">http://www.dxzq.net</a>

**(88) 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:	范力
联系人:	陆晓
电话:	0512-62938521
传真:	0512-65588021
客户服务电话:	4008601555
网址:	<a href="http://www.dwjq.com.cn">http://www.dwjq.com.cn</a>

**(89) 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:	<a href="http://www.cindasc.com">http://www.cindasc.com</a>

**(90) 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:	施华
联系人:	胡创
电话:	010-56437060
传真:	0731-85832214
客户服务电话:	95571
网址:	<a href="http://www.foundersc.com">http://www.foundersc.com</a>

**(91) 长城证券股份有限公司**

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:	丁益
联系人:	沈晓
电话:	0755-83464734
传真:	0755-83515567
客户服务电话:	4006666888
网址:	<a href="http://www.cgws.com">http://www.cgws.com</a>

**(92) 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:	刘秋明
联系人:	李芳芳
电话:	021-22169089
传真:	021-22169134
客户服务电话:	4008888788; 95525
网址:	<a href="http://www.ebscn.com/">http://www.ebscn.com/</a>

**(93) 东北证券股份有限公司**

注册地址:	长春市生态大街6666号
办公地址:	长春市生态大街6666号
法定代表人:	李福春
联系人:	安岩岩
电话:	0431-85096517
传真:	0431-85096795
客户服务电话:	95360
网址:	<a href="http://www.nesc.cn">http://www.nesc.cn</a>

**(94) 上海证券有限责任公司**

注册地址:	上海市黄浦区四川中路213号7楼
办公地址:	上海市黄浦区四川中路213号久事商务大厦7楼
法定代表人:	李俊杰

联系人:	魏熠琿
电话:	021-53686278
传真:	021-53686835
客户服务电话:	4008918918
网址:	<a href="https://www.shzq.com/">https://www.shzq.com/</a>

**(95) 新时代证券股份有限公司**

注册地址:	北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址:	北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人:	叶顺德
联系人:	田芳芳
电话:	010-83561000
传真:	010-83561001
客户服务电话:	95399
网址:	<a href="http://www.xsdzq.cn">http://www.xsdzq.cn</a>

**(96) 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:	<a href="http://www.dtsbc.com.cn">http://www.dtsbc.com.cn</a>

**(97) 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:	姚志勇
联系人:	祁昊
电话:	0510-82831662
传真:	0510-82830162
客户服务电话:	0510-82830162
网址:	<a href="http://www.glsc.com.cn">http://www.glsc.com.cn</a>

**(98) 浙商证券股份有限公司**

注册地址:	浙江省杭州市江干区五星路201号
办公地址:	浙江省杭州市江干区四季青街道五星路201号浙商证券5楼
法定代表人:	吴承根
联系人:	胡相斌
电话:	0571-87902239

传真:	0571-87901913
客户服务电话:	95345
网址:	<a href="http://www.stocke.com.cn/">http://www.stocke.com.cn/</a>

**(99)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:	何之江
联系人:	王阳
电话:	021-38632136
传真:	0755-82400862
客户服务电话:	0755-22628888/95511-8
网址:	<a href="http://www.stock.pingan.com">http://www.stock.pingan.com</a>

**(100)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:	章宏韬
联系人:	范超
电话:	0551-65161821
传真:	0551-65161672
客户服务电话:	95318
网址:	<a href="http://www.hazq.com/">http://www.hazq.com/</a>

**(101)国都证券股份有限公司**

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:	翁振杰
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:	<a href="http://www.guodu.com">http://www.guodu.com</a>

**(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:	钱俊文
联系人:	王一彦
电话:	021-20333333
传真:	021-50498825
客户服务电话:	95531; 4008888588

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

**(103) 恒泰证券股份有限公司**

注册地址:	内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银行办公楼14-18楼
办公地址:	内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银行办公楼14-18楼
法定代表人:	庞介民
联系人:	熊丽
电话:	0471-4972675
传真:	0471-4930707
客户服务电话:	400-196-6188
网址:	<a href="http://www.cnht.com.cn/">http://www.cnht.com.cn/</a>

**(104) 国盛证券有限责任公司**

注册地址:	江西省南昌市新建区子实路1589号
办公地址:	江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行大厦
法定代表人:	徐丽峰
联系人:	占文驰
电话:	0791-86283372
传真:	0791-6289395
客户服务电话:	4008222111
网址:	<a href="https://www.gszq.com/">https://www.gszq.com/</a>

**(105) 华西证券股份有限公司**

注册地址:	四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
办公地址:	四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
法定代表人:	杨炯洋
联系人:	张彬
电话:	010-58124967
传真:	028-86150040
客户服务电话:	95584
网址:	<a href="http://www.hx168.com.cn">http://www.hx168.com.cn</a>

**(106) 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:	李琦
联系人:	余敏
电话:	021-3338825
传真:	021-33388224
客户服务电话:	4008000562

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

**(107) 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:	朱琴
电话:	021-20315161
传真:	0531-68889357
客户服务电话:	95538
网址:	<a href="http://www.zts.com.cn">www.zts.com.cn</a>

**(108) 世纪证券有限责任公司**

注册地址:	深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 406
办公地址:	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼
法定代表人:	李强
联系人:	王雯
电话:	0755-83199511
传真:	0755-83199545
客户服务电话:	4008323000
网址:	<a href="http://www.csc.com.cn/">http://www.csc.com.cn/</a>

**(109) 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:	0755-2383875
传真:	0755-25838701
客户服务电话:	95358
网址:	<a href="http://www.firstcapital.com.cn/">http://www.firstcapital.com.cn/</a>

**(110) 德邦证券股份有限公司**

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:	武晓春
联系人:	刘熠
电话:	021-68761616
传真:	021-68767981
客户服务电话:	4008888128
网址:	<a href="http://www.tebon.com.cn">http://www.tebon.com.cn</a>

**(111) 西部证券股份有限公司**

注册地址:	陕西省西安市新城东大街 319 号 8 幢 10000 室
-------	-------------------------------



办公地址:	西安市新城区东新街 319 号
法定代表人:	徐朝晖
联系人:	梁承华
电话:	029-87406488
传真:	029-87406387
客户服务电话:	95582
网址:	<a href="http://www.west95582.com/">http://www.west95582.com/</a>

**(112) 华龙证券股份有限公司**

注册地址:	兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼
办公地址:	甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 19 楼
法定代表人:	陈牧原
联系人:	范坤
电话:	0931-4890208
传真:	0931-4890628
客户服务电话:	95368/400689888
网址:	<a href="http://www.hlzq.com/">http:// www.hlzq.com/</a>

**(113) 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:	浙江省杭州市天目山路 198 号财通双冠大厦西楼 1201 室
法定代表人:	陆建强
联系人:	陶志华
电话:	0571-87789160
传真:	0571-85071387
客户服务电话:	95336 (上海地区 962336)
网址:	<a href="http://www.ctsec.com">http://www.ctsec.com</a>

**(114) 华鑫证券有限责任公司**

注册地址:	深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1 房
办公地址:	上海市徐汇区宛平南路 8 号
法定代表人:	俞洋
联系人:	杨莉娟
电话:	021-54967552
传真:	021-64333051
客户服务电话:	95323, 021-32109999, 029-68918888
网址:	<a href="http://www.cfsc.com.cn">http://www.cfsc.com.cn</a>

**(115) 中山证券有限责任公司**

注册地址:	深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层
办公地址:	深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层
法定代表人:	林炳城
联系人:	罗艺琳

电话:	0755-82943755
传真:	0755-82960582
客户服务电话:	95329
网址:	<a href="http://www.zszq.com">http://www.zszq.com</a>

**(116) 粤开证券股份有限公司**

注册地址:	广州经济技术开发区科学大道60号开发区金控中心21、22、23层
办公地址:	深圳市福田区深南中路2002号中广核大厦北楼10层
法定代表人:	严亦斌
联系人:	彭莲
电话:	0755-83331195
客户服务电话:	95564
网址:	<a href="http://www.ykzq.com">http://www.ykzq.com</a>

**(117) 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:	贾鹏
电话:	028-86690057、028-86690058
传真:	028-86690126
客户服务电话:	4006-600109/95310
网址:	<a href="http://www.gjzq.com.cn">http://www.gjzq.com.cn</a>

**(118) 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:	<a href="http://www.cnhbstock.com">http://www.cnhbstock.com</a>

**(119) 爱建证券有限责任公司**

注册地址:	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32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:	祝健
联系人:	姚盛盛
电话:	021-32229888
传真:	021-68728703
客户服务电话:	4001-962-502

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

**(120) 华融证券股份有限公司**

注册地址:	北京市西城区金融大街8号
办公地址:	北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦12层
法定代表人:	张海文
联系人:	孙燕波
电话:	010-85556048
客户服务电话:	95390
网址:	<a href="http://www.hrsec.com.cn/">http://www.hrsec.com.cn/</a>

**(121) 天风证券股份有限公司**

注册地址:	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
办公地址:	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人:	余磊
联系人:	程晓英
电话:	027-87107535
客户服务电话:	400-800-5000/ 95391
网址:	<a href="http://www.tfzq.com/">http://www.tfzq.com/</a>

**(122) 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:	毕劲松
联系人:	李淑敏
电话:	010-59366077
客户服务电话:	400 620 0620
网址:	<a href="http://www.sczq.com.cn">www.sczq.com.cn</a>

**(123) 开源证券股份有限公司**

注册地址:	陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址:	陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人:	李刚
联系人:	张蕊
电话:	029-88365809
传真:	86-29-88365835
客户服务电话:	95325 /400-860-8866
网址:	<a href="http://www.kysec.cn/">http://www.kysec.cn/</a>

**(124) 联储证券有限责任公司**

注册地址:	深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店B座26楼
办公地址:	深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店B座26楼
法定代表人:	吕春卫
联系人:	张婉婷

电话:	010-86499765
传真:	0755-82075835
客户服务电话:	4006206868/010-56177851
网址:	<a href="http://www.lczq.com/">http://www.lczq.com/</a>

## 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

联系电话：0755-25946013

传真：0755-25987122

联系人：严峰

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

电话：021-51150298

传真：021-51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、刘翠

## 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：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室

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：沈兆杰

经办注册会计师：张振波、沈兆杰

## 第六部分 基金的募集与基金合同的生效

### 一、基金的募集

基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集本基金，并经中国证监会 2019 年 06 月 05 日证监许可[2019]1015 号文准予募集注册。

本基金募集期自 2019 年 06 月 24 日至 2019 年 06 月 24 日期间，基金份额共募集 996,787,785.37 份（含利息结转的份额），募集有效认购总户数为 40,232 户。

本基金的运作方式为契约型开放式，存续期间为不定期。基金合同生效后的前三年为封闭运作期。在封闭运作期内，本基金不办理申购和赎回业务。封闭运作期内基金上市交易后，投资者可将在其持有的场内基金份额上市交易或将场外基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“博时科创主题灵活配置混合型证券投资基金”，并接受场外、场内申购赎回。

### 二、基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2019 年 06 月 27 日正式生效。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第七部分 基金份额的上市交易

### 一、基金份额的上市交易

基金合同生效后，在符合法律法规和上海证券交易所规定的上市条件的情况下，本基金可申请在上海证券交易所上市交易。

### 二、上市交易的地点

上海证券交易所。

### 三、上市交易的时间

本基金已于 2019 年 12 月 26 日在上海证券交易所上市交易。

### 四、上市交易的规则

本基金在上海证券交易所的上市交易需遵循《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易规则》等有关规定及其不时修订和补充。

### 五、上市交易的费用

上市交易的费用按照上海证券交易所有关规定办理。

### 六、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

上市基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和上海证券交易所的相关规定执行。具体情况见基金管理人届时相关公告。

当本基金发生上海证券交易所相关业务规则规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金将变更为非上市的证券投资基金，无需召开基金份额持有人大会。基金变更并终止上市后，对于本基金场内份额的处理规则由基金管理人制定并按规定公告。

七、相关法律法规、中国证监会及上海证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，且此项修改无需召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

若上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，本基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，本基金可以申请在包括境外交易所在内的其他交易场所上市交易，无需召开基金份额持有人大会。



## 第八部分 基金份额的申购与赎回

本基金合同生效后的前三年为封闭运作期，封闭运作期内本基金不开放申购、赎回；封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“博时科创主题灵活配置混合型证券投资基金”，并接受场外、场内申购赎回。

### 一、封闭运作期届满后基金份额的申购与赎回

#### （一）申购和赎回场所

本基金场外申购与赎回场所为基金管理人的直销网点及其他基金场外销售机构的销售网点，场内申购和赎回场所为上海证券交易所内具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位，具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回。

#### （二）申购和赎回的开放日及时间

##### 1、开放日及开放时间

基金合同生效三年后，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金管理人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所及相关期货交易所的正常交易日的交易时间（若本基金投资港股通标的股票且该工作日为非港股通交易日，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回或其他业务，具体以届时提前发布的公告为准），但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在招募说明书或相关公告中载明。

若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

##### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自转为上市开放式基金（LOF）之日起 30 日内开始办理场内与场外份额的申购、赎回业务，具体业务办理时间在相关公告中规定。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。办理申购与赎回业务的具体事宜见基金管理人届时发布的相关公告。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的场外申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、本基金场外赎回遵循“先进先出”原则，即基金份额持有人在场外销售机构赎回基金份额时，按照基金份额持有人认购、申购确认的先后次序进行顺序赎回；

5、本基金场内申购、赎回等业务，按照上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则执行。若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行；

6、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### （四）申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资人赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

如遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障、港股通交易系统或港股通资金交收规则限制或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响了业务流程，则赎回款项划付时间相应顺延至该因素消除的最近一个工作日。

### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功或无效，则申购款项退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不对基金份额持有人利益造成损害的前提下，依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并必须在调整实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### (五) 申购和赎回的数量限制

1、本基金场外首次申购和追加申购的最低金额均为 1 元（含申购费，下同），基金销售机构另有规定的，以基金销售机构的规定为准。本基金场内申购单笔最低申购金额为 1000 元，超过 1000 元的须为 1 元的整数倍；基金销售机构另有规定的，以基金销售机构的规定为准；本基金直销机构最低申购金额及最低赎回份额由基金管理人制定和调整。

2、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体请参见相关公告。

3、本基金不对投资人每个交易账户的最低基金份额余额进行限制；

4、本基金不对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制，但法律法规或监管要求另有规定的除外；

5、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制，上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。

6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### （六）申购和赎回费用

1、本基金的场外和场内申购费率最高不高于 1.2%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示

申购金额 (M)，元	申购费率
M < 100 万	1.2%
100 万 ≤ M < 500 万	0.8%
500 万 ≤ M < 1000 万	0.2%
M ≥ 1000 万	每笔 1000 元

2、本基金转型后的赎回费由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。

本基金场内和场外的赎回费率一致，随基金份额的持有期限的增加而递减，具体如下（其中 1 年指 365 天）：

持有期限	赎回费率
N < 7 日	1.50%
7 日 ≤ N < 30 日	0.75%
30 日 ≤ N < 1 年	0.50%
1 年 ≤ N < 2 年	0.30%
N ≥ 2 年	0.00%

对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于 30 日（含 30 日）但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 75% 归入基金财产；对于持有期长于 3 个月（含 3 个月）但小于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 50% 归入基金财产；对于持有期长于 6 个月（含 6 个月）的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 25% 归入基金财产。

#### （七）申购份额的计算

##### 1、基金申购份额的计算

申购份额的计算公式为：

$$\text{申购费} = \text{有效申购金额} \times \text{申购费率} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购份额} = (\text{有效申购金额} - \text{申购费}) / T \text{ 日的基金份额净值}$$

当申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费} = \text{固定金额}$$

$$\text{申购份额} = (\text{有效申购金额} - \text{申购费}) / T \text{ 日的基金份额净值}$$

##### （1）场内申购举例

例：某个人投资者投资 10 万元场内申购本基金，对应费率为 1.2%，假设申购当日基金份额净值为 1.0160 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购费} = 100,000 \times 1.2\% / (1 + 1.2\%) = 1185.77 \text{ 元}$$

申购份额 =  $(100,000 - 1185.77) / 1.0160 = 97,258.10$  份（先按四舍五入的原则保留到小数点后两位）= 97,258 份（再按截位法保留到整数位）

$$\text{退回资金} = 0.10 \times 1.0160 = 0.10 \text{ 元}$$

投资者申购所得的场内份额先按四舍五入的原则保留到小数点后两位，再按截位法保留到整数位，小数部分对应的金额退还投资者。

#### （2）场外申购举例

例：某个人投资者投资 10 万元场外申购本基金，对应费率为 1.2%，假设申购当日基金份额的份额净值为 1.0160 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购费} = 100,000 \times 1.2\% / (1 + 1.2\%) = 1185.77 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = (100,000 - 1185.77) / 1.0160 = 97,258.10 \text{ 份}$$

申购所得的场外份额按四舍五入的原则保留到小数点后两位。

### 2、基金赎回金额的计算

赎回金额的计算公式为：

$$\text{赎回确认份额} = \text{赎回申请份额} \times \text{赎回确认比例}$$

$$\text{赎回费} = \sum (\text{赎回明细确认份额} \times \text{基金份额净值} \times \text{赎回费率})$$

$$\text{赎回确认金额} = \text{赎回确认份额} \times \text{基金份额净值} - \text{赎回费}$$

例：某投资人场外认购并持有至封闭运作期届满时赎回本基金 10 万份基金份额且全部确认，赎回费为 0，假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回费} = 0 \text{ 元}$$

$$\text{赎回确认金额} = 100,000 \times 1.0160 = 110,600.00 \text{ 元}$$

赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

### 3、基金份额净值的计算

T 日的基金份额的份额净值在当天收市后计算，并按照基金合同约定公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

### 4、申购份额、余额的处理方式

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以当日基金份额的份额净值为基准计算。场外申购涉及金额、份额的计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

场内申购份额先按四舍五入的原则保留到小数点后两位,再按截位法保留到整数位,小数部分对应的金额退还投资者。

#### 5、赎回金额的处理方式

赎回确认金额为按实际确认的赎回确认份额以当日基金份额净值为基准来计算并扣除相应的费用,计算结果保留到小数点后 2 位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

6、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低本基金的申购费率和赎回费。

7、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

8、办理场内申购、赎回业务应遵守上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定,基金合同相应予以修改,并按照新规定执行,且此项修改无需召开基金份额持有人大会审议。

#### (八) 申购和赎回的登记

投资人场外申购基金成功后,基金登记机构在 T+1 日为投资人登记权益并办理登记手续,投资人自 T+2 日(含该日)后有权赎回该部分基金份额。

投资人场外赎回基金成功后,基金登记机构在 T+1 日为投资人办理扣除权益的登记手续。

本基金场内申购和赎回的注册与过户登记业务,按照上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内,对上述登记办理时间进行调整,但不得实质影响投资人的合法权益,并最迟于实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### 三、拒绝或暂停申购的情形及处理方式



封闭运作期届满后,发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请:

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或者无法办理申购业务。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。

5、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、基金登记系统、基金会计系统或证券登记结算系统无法正常运行时。

7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%,或者变相规避 50%集中度的情形时。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### **四、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形**

封闭运作期届满后,发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。



3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或者无法办理赎回业务。

4、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时。

5、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形（第 5 项除外）之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，未支付部分可延期支付。若出现上述第 5 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。出现暂停赎回或延缓支付赎回款项时，场内赎回申请按照上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 五、封闭运作期届满后的巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的场外处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，

无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

当基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 30% 以上的赎回申请情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。如基金管理人对其超过基金总份额 30% 以上的赎回申请实施延期办理，基金管理人只接受其基金总份额 30% 部分作为当日有效赎回申请，且基金管理人可以根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。对单个基金份额持有人超过基金总份额 30% 以上的赎回申请延期赎回。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。基金份额持有人在提交赎回申请时可以事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销，延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（3）暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的场内处理方式

巨额赎回的场内处理按照上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

### 4、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式（包括但不限于短信、电子邮件或由基金销售机构通知等方式）在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

## 六、其他暂停申购和赎回的情形及处理方式

发生《基金合同》或《招募说明书》中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金申购、赎回的，可以经届时有效的合法程序宣布暂停接受投资人的申购、赎回申请。

## 七、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 八、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

## 九、基金份额的转让

对基金份额持有人无实质不利影响，在法律法规允许且条件具备的情况下，履行相关程序后，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

## 十、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

## 十一、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

## 十二、基金的转托管

基金份额持有人可根据登记机构的相关规定办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，包括系统内转托管和跨系统转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。募集期内本基金不得办理系统内转托管和跨系统转托管。

### **十三、基金份额的冻结和解冻与质押或其他基金业务**

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。法律法规或基金合同另有规定的除外。

如相关法律法规允许基金管理人履行相关程序后可办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。

### 二、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（含中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市的股票（含存托凭证））、内地与香港股票市场互联互通机制下允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债、次级债等）、股指期货、国债期货、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、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相关规定）。

在封闭运作期内，投资股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为0%—100%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的0%—50%，其中，投资于本基金界定的科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除国债期货和股指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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股票投资部分可以以战略配售的方式进行投资。

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。

### 三、投资策略

本基金以科创主题战略配售股票投资策略为主，并辅以科创主题相关股票一、二级市场投资策略和固定收益投资策略。本基金所界定的科技创新企业主要是指坚持面向世界科技前沿、面向经济主战场、面向国家重大需求，主要服务于符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业。重点支持新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业。主要来自于下列领域：

（1）新一代信息技术领域，主要包括半导体和集成电路、电子信息、下一代信息网络、人工智能、大数据、云计算、新兴软件、互联网、物联网和智能硬件等；

(2) 高端装备领域，主要包括智能制造、航空航天、先进轨道交通、海洋工程装备及相关技术服务等；

(3) 新材料领域，主要包括先进钢铁材料、先进有色金属材料、先进石化化工新材料、先进无机非金属材料、高性能复合材料、前沿新材料及相关技术服务等；

(4) 新能源领域，主要包括先进核电、大型风电、高效光电光热、高效储能及相关技术服务等；

(5) 节能环保领域，主要包括高效节能产品及设备、先进环保技术装备、先进环保产品、资源循环利用、新能源汽车整车、新能源汽车关键零部件、动力电池及相关技术服务等；

(6) 生物医药领域，主要包括生物制品、高端化学药、高端医疗设备与器械及相关技术服务等；

(7) 符合科创板定位的其他领域。

本基金将通过系统和深入的基本面研究，密切关注科技创新主题相关行业及公司，分享中国经济增长模式转变带来的投资机会。

未来如果基金管理人认为有更适当的科创主题划分标准，经履行适当程序后，基金管理人有权对科创主题的界定方法进行变更，并在招募说明书更新中公告。

本基金由于前三年为封闭运作期、并以科创类公司战略配售为主要投资策略，考虑到战略配售股票锁定期不少于 12 个月的特点，相应的投资策略包括：大类资产配置策略、股票资产的灵活配置策略、股票投资策略、固定收益投资策略和股指期货、国债期货投资策略。

#### (一) 大类资产配置策略

本基金通过跟踪考量宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势、外汇占款等）及国家财政、税收、货币、汇率各项政策，判断经济周期当前所处的位置及未来发展方向，并通过监测重要行业的产能利用与经济景气轮动研究，调整股票资产和固定收益资产的配置比例。

#### (二) 股票资产的灵活配置策略

本基金通过分析国内外宏观经济趋势和评估证券市场投资风险，确定市场当期的系统性风险收益比，对各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定基金在股票、债券、现金类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。在总体风险预算相对稳定的基础上，持续地进行定期与不定期的资产配置风险评估，适时地做出相应的调整，力求实现基金



组合的稳定增值。具体而言，本基金主要采用定性与定量相结合的方法决定股票资产配置比例，通过纵向和横向相对估值法决定市场风格导向，并确定最终科创主题股票资产配置比例。

(1) 定性分析

主要跟踪全球主要经济体 OECD 综合领先指标、PMI 指数、主要国家汇率和利率趋势、国债收益率期限结构和信用利差情况，分析各个国家最新经济周期情况和潜在的地缘政治风险因素，依据沪深 300 指数市净率 (P/B 值) 历史分位情况，初步确定基金在股票、债券、现金类大类资产配置比例。其次，依据创业板指数市净率 (P/B 值) 历史分位情况，评估科创类股票的相对估值吸引力，确定科创类股票资产配置比例。最后，通过纵向对比科创主题主要上市公司相比其在上市前历次融资时的估值水平，确定科创主题上市公司估值走廊，合理判断当期估值吸引力，最终确定科创主题股票资产配置比例。

(2) 定量分析

一般而言，本基金主要采用两个核心指标进行定量分析，用于指导科创类股票资产的配置比例：沪深 300 指数市净率历史分位，创业板指数市净率的历史百分位数据。

1) 当过去 5 年以来沪深 300 指数市净率、创业板指数市净率的区间均值均处于历史的后 20%分位时，表明当前 A 股整体、科创类股票均处于相对低估状态，我们将提升科创类股票资产配置，方式包括参与战略配售和二级市场买入，提升股票占基金资产的比例到 60%-100%。基金管理人应自上述条件触发之日起的 10 个交易日内调整完成以满足上述比例限制。

2) 当过去 5 年以来沪深 300 指数市净率、创业板指数市净率的区间均值均处于历史的前 20%分位时，表明当前 A 股整体、科创类股票均处于相对高估状态，我们将降低科创类股票资产配置，方式包括停止参与战略配售、以及二级市场卖出，降低股票占基金资产的比例到 0-40%。基金管理人应自上述条件触发之日起的 10 个交易日内调整完成以满足上述比例限制。

3) 除上述两种情况以外，本基金股票资产占基金资产的比例为 35%-80%，股票资产配置的重点是行业配置和个股选择，通过战略配售、新股申购、二级市场交易分享企业价值增长红利。我们将遵循优势企业的选择标准，寻找估值合理、盈利趋势向好的公司进行参与。基金管理人应自上述条件触发之日起的 10 个交易日内调整完成以满足上述比例限制。

过去 5 年以来沪深 300 指数 P/B 的区间均值处于	过去 5 年以来创业板指数 P/B 的区间均值处于	股票类资产比例 (S)
历史的后 20%分位	历史的后 20%分位	60%~100%



历史的前 20%分位	历史的前 20%分位	0%~40%
未触发上述条件的其他情形		35%~80%

### （三）股票投资策略

本基金的股票投资策略包括科创板股票战略配售投资策略、科创主题二级市场投资策略和存托凭证投资策略。

#### 1、科创板股票战略配售投资策略

本基金将深入分析并论证科创板股票战略配售的投资机会，综合分析宏观经济环境、行业竞争格局、公司基本面等多方面因素，结合未来市场走势判断，精选科创板战略配售股票。我们将区分上市公司所处的成长阶段，按照初期成长和稳定成长阶段采用不同的估值和定价策略进行价值评估。此外由于战略配售有一定的锁定期，因此在战略配售报价时需要考虑一定折价。我们将通过纵向对比和横向对比估值，确定战略配售参与合理报价水平，确保与战略配售锁定期相匹配的折价率。战略配售股票锁定期结束后，本基金可对股票的投资价值做出判断，结合市场环境及资产配置策略，在有效识别和防范风险的前提下，选择适当的退出时机，力争获取较高的投资回报。本基金的剩余封闭期应长于获配股票的剩余锁定期和减持期。

#### 2、科创主题相关股票一级市场投资策略

本基金可参与科创主题上市公司相关股票（包括但不限于科创板公司股票）的一级市场网下/网上新股申购。

#### 3、科创主题相关股票二级市场投资策略

本基金通过持续跟踪中国科技创新政策和产业路径，结合科创主题产业分析比较、上市公司战略规划及国际竞争力分析等方法，从产业竞争和上下游多角度挖掘科创范畴的投资主题及相关股票（包括但不限于科创板公司股票），精选具有估值优势的个股，作为重点进行投资。股票投资采用定量和定性分析相结合的策略：

##### 1) 定性分析

本基金采用定性分析的主要目的是，识别出全部或部分具备以下特征的科创主题上市公司：

A. 上市公司所处行业为国家产业政策鼓励，或者是限制国内相关产业发展、亟需补齐短板的紧缺产业；

B. 上市公司在行业中掌握核心技术优势，具有自主知识产权，具备一定竞争壁垒的核心竞争力；

C. 上市公司持续保持高强度的技术研发投入,并具备将研发成果转化为实用产品的能力

D. 上市公司具有良好的公司治理结构和社会责任历史,从公司控制人、管理层和中层技术人员均有完善的激励机制,企业信息披露公开透明;

## 2) 定量分析

由于科创主题上市公司的特殊性,本基金将公司分为两类,并采用相应的定量分析方法,以识别具备潜在盈利弹性或持续成长能力的个股进行投资。

A. 初期成长阶段:上市公司具备核心技术优势和产品转化能力,但由于处于行业成长初期,企业利润尚未体现。对这类公司,我们需要选取如下指标进行定量分析,识别相应投资价值。

成长性指标:行业增速和潜在市场空间,产业潜在空间/公司市值比,收入增长率,息税折旧前利润(EBITDA)增长率,经营性活动现金流入增长率,自由现金流增长率;

财务指标:毛利率、营业利润率、净资产收益率、投入资本回报率、经营性活动现金净流量、自由现金流净额、研发费用/收入比,息税折旧前利润/收入比,

估值指标:市销率(P/S),市净率(P/B)、市现率(P/CF)和总市值;

B. 稳定成长阶段:上市公司的产品已经形成稳定销售,行业竞争格局开始趋于稳定,企业利润开始逐步体现。对这类公司,我们需要选取如下指标进行定量分析,判断公司合理价值。

成长性指标:营业利润增长率、净利润增长率、收入增长率、经营性活动现金流入增长率;

财务指标:毛利率、营业利润率、净资产收益率、净利率、经营性活动现金净流入/利润总额等;

估值指标:市盈率(P/E)、市盈率相对盈利增长比率(PEG)、市净率(P/B)、市销率(PS)和总市值;

## 3) 组合股票的投资吸引力评估分析

本基金紧密对组合中股票进行动态评估,使用相对价值评估方法,形成最终股票组合进行投资。相对估值主要包括两个方面:

A. 纵向对比:采用专业估值模型,合理使用市盈率、市净率和市销率指标,评估并确定科创主题公司上市前历次融资中的估值走廊,确定二级市场公司估值中枢。

B. 横向对比：运用国际化视野，合理使用上述估值指标，评估并比较科创主题公司相对沪深市场/海外市场类似业务公司的估值指标，选择其中价值被低估的公司。

本基金采用包括自由现金流贴现模型、股息贴现模型、市盈率法、市净率法、PEG、EV/EBITDA、P/S、产业潜在空间/公司市值比等估值方法，选择最具投资价值的股票构建投资组合。

#### 4) 投资组合构建与优化

分别按照初期成长/稳定成长阶段的标准划分，定期动态评估基金组合中单个证券的预期收益及风险特性，对组合持仓进行动态优化，在合理风险水平下追求基金收益最大化。同时监控组合中证券的估值水平和企业社会责任履行情况，在市场价格明显高于其内在合理价值、或者公司治理/企业社会责任出现重大风险时卖出证券。

#### 5) 港股通标的股票投资策略

本基金基金资产通过港股通投资于港股，将重点关注以下几类港股通股票：

A. 在港股市场上市，行业中居于龙头地位，在技术或产品、市场竞争力强的代表性中资企业；

B. 所处行业为国家鼓励的科技行业、公司掌握核心技术优势、在我国境内有业务布局的香港本地和外资公司；

C. 港股市场在行业竞争结构、估值、AH股折溢价、股息率等方面具有吸引力的投资标的。

#### 4、存托凭证投资策略

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

#### （四）固定收益投资策略

在选择债券品种时，首先根据宏观经济、资金面动向和投资人行为等方面的分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，采用放大操作、骑乘操作、换券操作等灵活多样的操作方式，获取超额的投资收益。

#### （五）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。

（六）为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本基金可参与融资业务。

在条件许可的情况下，基金管理人可根据相关法律法规，参与融券业务和转融通证券出借业务。

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）封闭运作期内，本基金投资股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 0%—100%，其中，投资于本基金界定的科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%—50%；

（2）本基金持有一家公司发行的证券（含存托凭证），其市值（若同时持有一家公司发行的 A 股和 H 股，则为 A 股与 H 股合计市值）不超过基金资产净值的 10%；

（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（含存托凭证），不超过该证券（若同时持有一家公司发行的 A 股和 H 股，则为 A 股与 H 股合计市值）的 10%；

（4）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（5）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（6）本基金在封闭运作期内总资产不得超过基金净资产的 200%；

（7）本基金参与股指期货、国债期货投资的，应遵循下列限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2) 在任何交易日日终, 本基金持有的买入股指期货和国债期货合约价值和有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 100%; 其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

3) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;

4) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;

5) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关规定;

6) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入国债期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 15%;

7) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;

8) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%;

9) 本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

(8) 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。其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(9) 基金参与融资业务后, 在任何交易日日终, 持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%;

(10) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(8)条情形之外, 因证券、期货市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内, 本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

## 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率×50%+中证港股通综合指数（人民币）×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×30%。

中国战略新兴产业成份指数选取节能环保产业、新一代信息技术产业、生物产业、高端装备制造产业、新能源产业、新材料产业、新能源汽车产业、数字创意产业、高技术服务业等领域具有代表性的 100 家上市公司，采用自由流通股本加权方式，以反映中国战略新兴产业上市公司的整体走势。科创主题上市企业所属领域集中于电子信息半导体、计算机通信、节能环保、先进制造装备、医药生物等主要行业。中国战略新兴产业成份指数的行业分布与



科创主题拟上市公司结构最为接近,上述五大行业在中国战略新兴产业成份指数中的权重占比超过 50%。因此选取中国战略新兴产业成份指数作为科创主题上市公司指数基准具备合理性。中证港股通综合指数(人民币)可以较好地代表港股市场业绩表现,适合作为本基金港股股票组合的业绩比较基准。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基准的指数时,本基金可以在与基金托管人协商一致的情况下,报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时,基金管理人可以按相关监管部门要求履行相关手续后,依据维护基金份额持有人合法权益的原则,选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数,而无需召开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金为混合型证券投资基金,其预期风险收益水平高于债券型基金与货币市场型基金,低于股票型基金。本基金以投资科创主题战略配售股票为主要投资策略,由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。

## 七、封闭运作期届满转为“博时科创主题灵活配置混合型证券投资基金”后的投资目标、范围、策略等

封闭运作期届满后,本基金的基金名称变更为“博时科创主题灵活配置混合型证券投资基金”。

### (一) 投资目标

在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。

### (二) 投资范围

本基金投资于国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市的股票)、内地与香港股票市场互联互通机制下允许买卖的香港证券市场股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债、



次级债等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、国债期货、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）。

本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 0%-95%；投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；每个交易日日终，在扣除国债期货和股指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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。

### （三）投资策略

本基金立足于投资从事科技创新的先锋或龙头企业发行的股票。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、股票灵活配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、可转债可交债投资策略。

#### 1、资产配置策略

本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。

#### 2、股票灵活配置策略

本基金通过分析国内外宏观经济趋势和评估证券市场投资风险，确定市场当期的系统性风险收益比，对各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定基金在股票、债券、现金类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。在总体风险预算相对稳定的基础上，持续地进行定期与不定期的资产配置风险评估，适时地做出相应的调整，力求实现基金组合的稳定增值。具体而言，本基金主要采用定性与定量相结合的方法决定股票资产配置比例，通过纵向和横向相对估值法决定市场风格导向，并确定最终科创主题股票资产配置比例。

##### （1）定性分析

主要跟踪全球主要经济体 OECD 综合领先指标、PMI 指数、主要国家汇率和利率趋势、国债收益率期限结构和信用利差情况，分析各个国家最新经济周期情况和潜在的地缘政治风险因素，依据沪深 300 指数市净率（P/B 值）历史分位情况，初步确定基金在股票、债券、现金类大类资产配置比例。其次，依据创业板指数市净率（P/B 值）历史分位情况，评估科创类股票的相对估值吸引力，确定科创类股票资产配置比例。最后，通过纵向对比科创主题主要上市公司相比其在上市前历次融资时的估值水平，确定科创主题主要上市公司估值走廊，合理判断当期估值吸引力，最终确定科创主题股票资产配置比例。

(2) 定量分析

主要采用两个核心指标进行定量分析，用于指导科创类股票资产的配置比例：沪深 300 指数市净率历史分位，创业板指数市净率的历史百分位数据。

1) 当过去 5 年以来沪深 300 指数市净率、创业板指数市净率的区间均值均处于历史的后 20%分位时，表明当前 A 股整体、科创类股票均处于相对低估状态，我们将提升科创类股票资产配置，方式包括一级市场新股申购和二级市场买入，提升股票占基金资产的比例到 60%-95%。基金管理人应自上述条件触发之日起的 10 个交易日内调整完成以满足上述比例限制。

2) 当过去 5 年以来沪深 300 指数市净率、创业板指数市净率的区间均值均处于历史的前 20%分位时，表明当前 A 股整体、科创类股票均处于相对高估状态，我们将降低科创类股票资产配置，方式包括停止参与一级市场新股申购和二级市场卖出，降低股票占基金资产的比例到 0-40%。基金管理人应自上述条件触发之日起的 10 个交易日内调整完成以满足上述比例限制。

3) 除上述两种情况以外，本基金股票资产占基金资产的比例为 35%-80%，股票资产配置的重点是行业配置和个股选择，通过新股申购、二级市场交易分享企业价值增长红利。我们将遵循优势企业的选择标准，寻找估值合理、盈利趋势向好的公司进行参与。基金管理人应自上述条件触发之日起的 10 个交易日内调整完成以满足上述比例限制。

过去 5 年以来沪深 300 指数 P/B 的区间均值处于	过去 5 年以来创业板指数 P/B 的区间均值处于	股票类资产比例(S)
历史的后 20%分位	历史的后 20%分位	60%~95%
历史的前 20%分位	历史的前 20%分位	0%~40%
未触发上述条件的其他情形		35%~80%

3、股票投资策略

本基金的股票投资策略主要包括科创主题投资策略和科创板股票投资策略，具体包括一级市场新股申购和二级市场股票投资。

#### （1）科创主题投资策略

本基金采用主题投资策略，通过持续跟踪中国科技创新政策和产业路径，结合科技创新产业分析比较、上市公司战略规划及国际竞争力分析等方法，挖掘属于科技创新范畴的投资主题及相关股票（包括但不限于科创板公司股票），精选具有估值优势的个股，作为重点进行投资。

本基金对科创主题企业的界定参见本章上文“三、投资策略”。

未来如果基金管理人认为有更适当的科技创新主题划分标准，经履行适当程序后，基金管理人有权对科技创新主题的界定方法进行变更，并在招募说明书更新中公告。

#### （2）科创板股票投资策略

本基金依托于基金管理的投资研究平台，跟踪并深入研究海外及国内科技创新行业的技术趋势、行业成长和市场格局，努力寻找并投资于所处市场空间广阔、具备技术产品优势和市场先导优势的科技企业，分享中国科技企业成长红利。科创板股票投资采用定量和定性分析相结合的策略：

##### 1) 定性分析

本基金采用定性分析的主要目的是，识别出全部或部分具备以下特征的科创板上市公司：

A. 上市公司所处行业为国家产业政策鼓励，或者是限制国内相关产业发展、亟需补齐短板的紧缺产业；

B. 上市公司在行业中掌握核心技术优势，具有自主知识产权，具备一定竞争壁垒的核心竞争力；

C. 上市公司持续保持高强度的技术研发投入，并具备将研发成果转化为实用产品的能力

D. 上市公司具有良好的公司治理结构和社会责任历史，从公司控制人、管理层和中层技术人员均有完善的激励机制，企业信息披露公开透明；

##### 2) 定量分析

由于科创板上市公司的特殊性，本基金将公司分为两类，并采用相应的定量分析方法，以识别具备潜在盈利弹性或持续成长能力的个股进行投资。

A. 初期成长阶段：上市公司具备核心技术优势和产品转化能力，但由于处于行业成长初期，企业利润尚未体现。对这类公司，我们需要选取如下指标进行定量分析，识别相应投资价值。

成长性指标：行业增速和潜在市场空间，产业潜在空间/公司市值比，收入增长率，息税折旧前利润（EBITDA）增长率，经营性活动现金流入增长率，自由现金流增长率；

财务指标：毛利率、营业利润率、净资产收益率、投入资本回报率、经营性活动现金净流量、自由现金流净额、研发费用/收入比，息税折旧前利润/收入比，

估值指标：市销率（P/S），市净率（P/B）、市现率（P/CF）和总市值；

B. 稳定成长阶段：上市公司的产品已经形成稳定销售，行业竞争格局开始趋于稳定，企业利润开始逐步体现。对这类公司，我们需要选取如下指标进行定量分析，判断公司合理价值。

成长性指标：营业利润增长率、净利润增长率、收入增长率、经营性活动现金流入增长率；

财务指标：毛利率、营业利润率、净资产收益率、净利率、经营性活动现金净流入/利润总额等；

估值指标：市盈率（P/E）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、市净率（P/B）、市销率（PS）和总市值；

### 3) 组合股票的投资吸引力评估分析

本基金紧密对组合中股票进行动态评估，使用相对价值评估方法，形成最终股票组合进行投资。相对估值主要包括两个方面：

A. 纵向对比：采用专业估值模型，合理使用市盈率、市净率和市销率指标，评估并确定科创板公司上市前历次融资中的估值走廊，确定二级市场公司估值中枢。

B. 横向对比：运用国际化视野，合理使用上述估值指标，评估并比较科创板公司相对沪深市场/海外市场中类似业务公司的估值指标，选择其中价值被低估的公司。

本基金采用包括自由现金流贴现模型、股息贴现模型、市盈率法、市净率法、PEG、EV/EBITDA、P/S、产业潜在空间/公司市值比等估值方法，选择最具投资价值的股票构建投资组合。

### 4) 投资组合构建与优化

分别按照初期成长/稳定成长阶段的标准划分，定期动态评估基金组合中单个证券的预期收益及风险特性，对组合持仓进行动态优化，在合理风险水平下追求基金收益最大化。同时监控组合中证券的估值水平和企业社会责任履行情况，在市场价格明显高于其内在合理价值、或者公司治理/企业社会责任出现重大风险时卖出证券。

#### 5) 港股通标的股票投资策略

本基金基金资产通过港股通投资于港股，将重点关注以下几类港股通股票：

A. 在港股市场上市，行业中居于龙头地位，在技术或产品、市场竞争力强的代表性中资企业；

B. 所处行业为国家鼓励的科技行业、公司掌握核心技术优势、在我国境内有业务布局的香港本地和外资公司；

C. 港股市场在行业竞争结构、估值、AH 股折溢价、股息率等方面具有吸引力的投资标的。

#### 4、债券投资策略

在选择债券品种时，首先根据宏观经济、资金面动向和投资人行为等方面的分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，采用放大操作、骑乘操作、换券操作等灵活多样的操作方式，获取超额的投资收益。

#### 5、股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时，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，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指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股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指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、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、交易活跃的国债期货合约，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。

#### 7、资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

#### 8、可转债可交债投资策略

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，再根据可转债、可交债的特性选择各行业不同的券种。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，增强本金投资的相对安全性；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。

9、为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本基金可参与融资业务。

在条件许可的情况下，基金管理人可根据相关法律法规，参与融券业务和转融通证券出借业务。

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

### （四）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%，投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；

（2）每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值（若同时持有一家公司发行的 A 股和 H 股，则为 A 股与 H 股合计市值）不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券（若同时持有一家公司发行的 A 股和 H 股，则为 A 股与 H 股合计市值）的 10%；

(5) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(6) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(7) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(10) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15) 本基金参与股指期货、国债期货投资的，应遵循下列限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；



2) 在任何交易日日终, 本基金持有的买入股指期货和国债期货合约价值和有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%; 其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

3) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;

4) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;

5) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关规定;

6) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入国债期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 15%;

7) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;

8) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%;

9) 本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

(16) 本基金在总资产不得超过基金净资产的 140%;

(17) 基金参与融资业务后, 在任何交易日日终, 持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%;

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(6)、(7)、(12)项另有约定外, 因证券/期货市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自封闭运作期届满转为上市开放式基金(LOF)之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内, 本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

### (五) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率×50%+中证港股通综合指数（人民币）×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×30%。

中国战略新兴产业成份指数选取节能环保产业、新一代信息技术产业、生物产业、高端装备制造产业、新能源产业、新材料产业、新能源汽车产业、数字创意产业、高技术服务业等领域具有代表性的 100 家上市公司，采用自由流通股本加权方式，以反映中国战略新兴产业上市公司的整体走势。科创主题上市企业所属领域集中于电子信息半导体、计算机通信、节能环保、先进制造装备、医药生物等主要行业。中国战略新兴产业成份指数的行业分布与

科创主题拟上市公司结构最为接近,上述五大行业在中国战略新兴产业成份指数中的权重占比超过 50%。因此选取中国战略新兴产业成份指数作为科创主题上市公司指数基准具备合理性。中证港股通综合指数(人民币)可以较好地代表港股市场业绩表现,适合作为本基金港股股票组合的业绩比较基准。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基准的指数时,本基金可以在与基金托管人协商一致的情况下,报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时,基金管理人可以按相关监管部门要求履行相关手续后,依据维护基金份额持有人合法权益的原则,选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数,而无需召开基金份额持有人大会。

#### (六) 风险收益特征

本基金为混合型基金,一般而言,其预期风险收益水平高于债券基金与货币市场型基金,低于股票型基金。本基金可投资港股通标的股票,除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 八、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利,保护基金份额持有人的利益;

2、不谋求对上市公司的控股;

3、有利于基金财产的安全与增值;

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

### 九、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2020年06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	1,190,083,867.09	78.33
	其中：股票	1,190,083,867.09	78.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	203,409,468.75	13.39
8	其他各项资产	125,868,868.95	8.28
9	合计	1,519,362,204.79	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额171,190,174.47元，占基金总资产比例11.27%。

### 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	765,434,504.32	51.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,375,537.12	0.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	206,633,607.72	13.78
J	金融业	-	-
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	40,437,277.14	2.70
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,018,893,692.62	67.93

## 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	29,723,949.60	1.98
信息技术	141,466,224.87	9.43
合计	171,190,174.47	11.41

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 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	002475	立讯精密	2,599,336	133,475,903.60	8.90
2	0981	中芯国际	3,936,000	97,073,095.68	6.47
3	300750	宁德时代	548,000	95,549,280.00	6.37
4	688009	中国通号	11,839,000	75,177,650.00	5.01
5	688111	金山办公	172,440	58,902,055.20	3.93
6	300567	精测电子	820,289	55,984,724.25	3.73
7	300454	深信服	264,700	54,517,612.00	3.63
8	300782	卓胜微	118,040	47,897,090.80	3.19
9	0268	金蝶国际	2,697,000	44,393,129.19	2.96
10	000725	京东方A	9,003,200	42,044,944.00	2.80

## 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 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

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变	风险说明
----	----	-----	------	-------	------

			(元)	动(元)	
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					-5,244,000.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-

注：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	982,290.83
2	应收证券清算款	124,774,765.76
3	应收股利	86,399.95
4	应收利息	25,412.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	125,868,868.95

#### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688009	中国通号	75,177,650.00	5.01	战略配售限售

#### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。



## 第十部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

自基金合同生效开始，基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

期间	①净值增长率	②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
2019.06.27-2019.12.31	13.81%	0.85%	10.76%	0.63%	3.05%	0.22%
2020.01.01-2020.06.30	32.21%	2.04%	15.40%	1.23%	16.81%	0.81%
2019.06.27-2020.06.30	50.47%	1.53%	27.82%	0.96%	22.65%	0.57%

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类证券、银行存款本息和基金应收款项以及其他投资所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十二部分 基金资产的估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### 二、估值对象

基金所拥有的股票、债券、衍生工具和其他投资等持续以公允价值计量的金融资产及负债。

### 三、估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

### 四、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有约定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人共同确定；

(3) 交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值。

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市或未挂牌转让的股票、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回

售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

5、本基金投资股指期货合约、国债期货合约，按估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、汇率：本基金外币资产价值计算中，涉及主要货币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准；涉及到其它币种与人民币之间的汇率，参照数据服务商提供的当日各种货币兑美元折算率采用套算的方法进行折算。

7、当基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

8、如有确凿证据表明按原有方法进行估值不能客观反映上述资产或负债公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

9、相关法律法规以及监管部门、自律规则另有规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如本基金转为“博时科创主题灵活配置混合型证券投资基金”，投资品种新增事项的估值方法遵照相关法律法规以及监管部门的规定，并相应更新。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值的计算结果对外予以公布。

## 五、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

## 六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

### 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。



(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”),则估值错误责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

(1) 查明估值错误发生的原因,列明所有的当事人,并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方;

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估;

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失;

(4) 根据估值错误处理的方法,需要修改基金登记机构交易数据的,由基金登记机构进行更正,并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

(1) 基金份额净值计算出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的0.25%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案;错误偏差达到基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告,并报中国证监会备案。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。如果行业另有通行做法,基金管理人、基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

## 七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金应当暂停估值；

4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### **八、基金净值的确认**

基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值按规定予以公布。

#### **九、特殊情况的处理**

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、指数编制机构及登记结算公司等机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 第十三部分 基金的收益分配

### 一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 三、基金收益分配原则

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在与基金托管人协商一致，并按照监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日在指定媒介公告。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，按规定在指定媒介公告。

### 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。对于场内份额，遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

## 第十四部分 基金的费用与税收

### 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、基金上市费用及年费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金相关账户的开户及维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 11、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、封闭运作期内基金费用计提方法、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 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金托管人按照与基金管理人核对一致的数据，通过与基金管理人协商一致的方式自动于次月前 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、公休日等，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 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金托管人按照与基金管理人核对一致的数据，通过与基金管理人协商一致的方式自动于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 3—11 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、封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后的基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金托管人按照与基金管理人核对一致的数据，通过与基金管理人协商一致的方式自动于次月前 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、公休日等，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 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金托管人按照与基金管理人核对一致的数据，通过与基金管理人协商一致的方式自动于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 3—11 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。

### 四、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。

## 五、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。

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按规定在指定媒介公告。

## 第十六部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、披露内容、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定媒介披露，并保证基金投资人能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### 三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- (一) 基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资人重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资人决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

5、基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在各自网站上。

#### （二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

#### （三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

#### （四）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的3个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定网站上，并将上市交易公告书提示性公告登载在指定报刊上。

#### （五）基金净值信息

1、本基金封闭运作期内，在开始办理基金上市交易前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在本基金基金份额上市交易后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

2、转为上市开放式基金（LOF），在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值，在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### （六）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （七）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下

披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### （八）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当按规定编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；



- 14、基金收益分配事项；
- 15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 17、本基金开始办理申购、赎回；
- 18、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 21、在发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 23、本基金转为上市开放式基金（LOF）；
- 24、基金份额停牌、暂停上市、恢复上市或终止上市；
- 25、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定和基金合同约定的其他事项。

#### （九）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会和基金上市交易的证券交易所。

#### （十）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十一）清算报告

基金终止运作的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （十二）中国证监会规定的其他信息。

在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与港股通交易的相关情况。若中国证监会对公开募集证券投资基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资香港股票市场的信息披露另有规定的，从其规定。

本基金在招募说明书（更新）等文件中披露国债期货和股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货和股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，本基金在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细；在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

## 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规以及证券交易所的自律管理规则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介和基金上市的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

## 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

#### 八、暂停或延迟披露基金相关信息的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、不可抗力；
- 3、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

## 第十七部分 风险揭示

### 一、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险；

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险；

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响；

4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避；

5、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降；

6、信用风险。主要是指债务人的违约风险，若债务人经营不善，资不抵债，债权人可能会损失掉大部分的投资，这主要体现在企业债中；

7、债券收益率曲线变动风险。债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在；

8、再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较少的收益率。

### 二、管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平，造成管理风险。

### 三、流动性风险

### 1、本基金的申购、赎回安排

基金合同生效后的前三年为封闭运作期。在封闭运作期内，本基金不办理申购和赎回业务。

本基金在封闭运作期内不接受申购和赎回。封闭运作期内基金上市交易后，投资者可将在其持有的场外基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“博时科创主题灵活配置混合型证券投资基金”，并接受场外、场内申购赎回。

### 2、投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资标的均在证监会及相关法律法规规定的合法范围之内。本基金的投资范围的设定合理、明确，操作性较强。封闭运作期内，不接受申购和赎回申请，股票资产投资比例为基金资产的 0%—100%，封闭运作期届满后，股票资产投资比例为 0%—95%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。实际投资过程中，在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的相关要求，本基金会审慎评估所投资资产的流动性，并针对性制定流动性风险管理措施，因此本基金流动性风险也可以得到有效控制。

### 3、封闭运作期届满后巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的

赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

当基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 30%以上的赎回申请情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。如基金管理人对其超过基金总份额 30%以上的赎回申请实施延期办理，基金管理人只接受其基金总份额 30%部分作为当日有效赎回申请，且基金管理人可以根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。对单个基金份额持有人超过基金总份额 30%以上的赎回申请延期赎回。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。基金份额持有人在提交赎回申请时可以事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销，延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（3）暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响本基金在面临大规模赎回的情况下有可能因为无法变现造成流动性风险。

如果出现流动性风险，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可实施备用的流动性风险管理工具，包括但不限于暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、摆动定价、暂停基金估值等，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，同时基金管理人应时刻防范可能产生的流动性风险，对流动性风险进行日常监控，保护持有人的利益。当实施备用的流动性风险管理工具时，有可能无法按合同约定的时限支付赎回款项。

#### 四、其他风险

1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；



- 2、因业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等不完善而产生的风险；
- 3、因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；
- 4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- 5、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 6、不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；
- 7、其他意外导致的风险。

## 五、本基金特有的风险

1、本基金为混合型基金，封闭运作期内，股票资产投资比例为基金资产的0%—100%；因此，国内股票市场和债券市场的变化均会影响到基金业绩表现，基金净值表现因此可能受到影响。本基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。

### 2、参与科创板战略配售的风险

本基金以参与投资科创板股票战略配售为主要投资策略，由于科创板股票的配售政策、配售比例以及中签率的不确定性，因此参与的每个项目均存在最终未获配售的风险。

### 3、投资于科创板战略配售相关股票的风险

本基金以投资科创板战略配售股票为主要投资策略，需参与并接受发行人战略配售股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。科创板战略配售股票有可能出现股价波动较大的情况，投资者有可能面临战略配售股票价格大幅波动的风险。

### 4、投资科创板股票的特有风险

1) 科创板流动性相比主板较弱。科创板对投资者进行适当性管理，以机构投资者为主，个人投资者需满足一定的日均资产及交易经验要求。在特殊市场环境下，可能导致市场存在一致预期，大幅减持科创板股票导致市场流动性进一步下降的情况。

2) 科创板退市制度较主板更为严格，退市风险更大。具体体现在退市情景更多、退市时间更短，退市速度更快等方面。

退市情景方面，具体包括：存在欺诈发行、重大信息披露违法或者其他严重损害证券市场秩序的重大违法行为，且严重影响上市地位；存在涉及国家安全、公共安全、生态安全、生产安全和公众健康安全等领域的违法行为，情节恶劣，严重损害国家利益、社会公共利益，或者严重影响上市地位；交易量、股价、市值等、股东数量交易指标触及终止上市标准；公

司丧失持续经营能力、财务指标触及上市标准等情景。情景较主板更多，且新增交易类指标低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷等退市的情形。

退市时间和退市速度方面，科创公司触及终止上市标准的，股票直接终止上市，不再适用暂停上市、恢复上市、重新上市程序。退市速度较主板更快。

3) 科创板股票特征相似，科创板基金投资科创主题股票集中度较高，难以通过分散投资进行风险分散。科创板股票聚焦科技型和创新型中小企业，重点面向尚未进入成熟期但具有成长潜力、且满足有关规范性及科技型创新型特征中小企业，包括但不限于电子、医药、通信、计算机、军工、机械、新能源等创新方向。由于科创板公司大多数处于初创期，上市标准相对宽松，具有研发投入大、经营风险高、业绩不稳定等特点，整体风险较高。

#### 5、二级市场折溢价风险

本基金基金合同生效后进入三年的封闭运作期，封闭运作期间投资者不能赎回基金份额。本基金在封闭运作期间，基金份额可上市交易，投资者可在二级市场买卖基金份额。受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。

#### 6、封闭运作期内无法赎回的风险

本基金封闭运作期内不开放赎回，投资者无法在封闭运作期内赎回，除可能通过二级市场上市交易外，只能在封闭运作期届满后才能提交赎回。

#### 7、本基金认购或申购的比例确认风险

本基金管理人在募集期内实行限量销售，设定规模上限并采用末日比例确认的方式。若当日本基金达到规模上限，则该日投资人的认购或申购申请存在部分确认的情况。

#### 8、本基金投资股指期货的风险

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，主要存在以下风险：

- (1) 市场风险：是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。
- (2) 流动性风险：是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。
- (3) 基差风险：是指股指期货合约价格和标的指数价格之间的价格差的波动所造成的风险。
- (4) 保证金风险：是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。
- (5) 杠杆风险：因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

(6) 信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

(7) 操作风险：是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

9、本基金投资范围包括国债期货，可能给本基金带来额外风险，包括杠杆风险、期货价格与基金投资品种价格的相关度降低带来的风险等，由此可能增加本基金净值的波动性。

#### 10、资产支持证券（ABS）的风险

封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，基金可以投资资产支持证券。资产支持证券（ABS）是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券，所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等。

11、本基金封闭运作期内基金总资产可不超过基金净资产的 200%，可能造成本基金资产净值波动大于普通开放式基金的风险。

#### 12、投资港股通股票的风险

本基金投资于法律法规规定范围内的香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险、市场制度以及交易规则不同等境外证券市场投资所面临的特有风险，包括但不限于：

##### （1）汇率风险

在现行港股通机制下，港股的买卖是以港币报价，以人民币进行支付，并且资金不留港（港股交易后结算的净资金余额头寸以换汇的方式兑换为人民币），故本基金每日的港股买卖结算将进行相应的港币兑人民币的换汇操作，本基金承担港元对人民币汇率波动的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支的风险。另外本基金对港股买卖每日结算中所采用的报价汇率可能存在报价差异，本基金可能需额外承担买卖结算汇率报价点差所带来的损失；同时根据港股通的规则设定，本基金在每日买卖港股申请时将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，该参考汇率买入价和卖出价设定上存在比例差异，以抵御该日汇率波动而带来的结算风险，本基金将因此而遭遇资金被额外占用进而降低基金投资效率的风险。

##### （2）香港市场风险

与内地 A 股市场相比，港股市场上外汇资金流动更为自由，海外资金的流动对港股价格的影响巨大，港股价格与海外资金流动表现出高度相关性，本基金在参与港股市场投资时受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统风险相对更大。加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在，港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动。

### （3）香港交易市场制度或规则不同带来的风险

香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，在“内地与香港股票市场交易互联互通机制”下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

①港股市场实行 T+0 回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当日卖出），同时对个股不设涨跌幅限制，因此每日涨跌幅空间相对较大；

②只有内地与香港均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日；

③香港出现台风、黑色暴雨或者香港联合交易所规定的其他情形时，香港联合交易所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现内地证券交易所证券交易服务公司认定的交易异常情况时，内地证券交易所证券交易服务公司将可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。

### ④交收制度带来的基金流动性风险

由于香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交收）的交收安排，本基金在 T 日（港股通交易日）卖出股票，T+2 日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）才能在香港市场完成清算交收，卖出的资金在 T+3 日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险，同时也存在不能及时调整基金资产组合中港股投资比例，造成比例超标的风险。

### ⑤香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联合交易所规定，在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时，上市公司方可采取停牌措施。此外，不同于内地 A 股市场的停牌制度，香港联合交易所对停牌的具体时长并没有量化规定，只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则；同时与 A 股市场对存在退市可能的上市公司根据其财务状况在证券简称前加入相应标记（例如，ST 及\*ST 等标记）以警示投资者风险的做法不同，在香港联合交易所市场没有风险警示板，香港联合交易所采用非量化的

退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权,使得香港联合交易所上市公司的退市情形较 A 股市场相对复杂。

因该等制度性差异,本基金可能存在因所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而给基金带来损失的风险。

#### (4) 港股通制度限制或调整带来的风险

##### ① 港股通额度限制

现行的港股通规则,对港股通设有每日额度上限的限制;本基金可能因为港股通市场每日额度不足,在香港联合交易所开市前阶段,新增的买单申报将面临失败的风险;在香港联合交易所持续交易时段或者收市竞价交易时段,当日本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

##### ② 港股通可投资标的范围调整带来的风险

现行的港股通规则,对港股通下可投资的港股范围进行了限制,并定期或不定期根据范围限制规则对具体的可投资标的进行调整,对于调出在投资范围的港股,只能卖出不能买入;本基金可能因为港股通可投资标的范围的调整而不能再进行调出港股的买入交易风险及股价波动风险。

##### ③ 港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则,只有内地与香港均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日,存在港股通交易日不连贯的情形(如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但港股通不能如常进行交易),而导致基金所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中体现市场反应而造成其价格波动骤然增大,进而导致本基金所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险。

##### ④ 港股通下对公司行为的处理规则带来的风险

根据现行的港股通规则,本基金因所持港股通标的股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况,所取得的港股通标的股票以外的香港联合交易所上市证券,只能通过港股通卖出,但不得买入;因港股通标的股票权益分派或者转换等情形取得的香港联合交易所上市股票的认购权利在香港联合交易所上市的,可以通过港股通卖出,但不得行权;因港股通标的股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非香港联合交易所上市证券,可以享有相关权益,但不得通过港股通买入或卖出。本基金存在因上述规则,利益得不到最大化甚至受损的风险。



#### ⑤代理投票

由于中国证券登记结算有限责任公司是在汇总投资者意愿后再向香港中央结算有限公司提交投票意愿,中国证券登记结算有限责任公司对投资者设定的意愿征集期比香港中央结算有限公司的征集期稍早结束;投票没有权益登记日的,以投票截止日的持有作为计算基准;投票数量超出持有数量的,按照比例分配持有基数。

#### (5) 法律和政治风险

由于香港市场适用不同法律法规的原因,可能导致本基金的某些投资行为受到限制或合同不能正常执行,从而使得基金资产面临损失的可能性。此外,香港市场可能会不时采取某些管制措施,如资本或外汇管制、没收资产以及征收高额税收等,从而对基金收益以及基金资产带来不利影响。

#### (6) 会计制度风险

香港市场对上市公司日常经营活动的会计处理、财务报表披露等会计核算标准的规定可能与境内存在一定差异,可能导致基金经理对公司盈利能力、投资价值的判断产生偏差,从而给本基金投资带来潜在风险。

#### (7) 税务风险

香港市场在税务方面的法律法规可能与境内存在一定差异,可能会要求基金就股息、利息、资本利得等收益向当地税务机关缴纳税金,该行为会使基金收益受到一定影响。此外,香港市场的税收规定可能发生变化,或者实施具有追溯力的修订,从而导致基金向该市场所在地缴纳在基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。

### 13、投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证,除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与中国存托凭证发行机制相关的风险,包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险;存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险;存托协议自动约束存托凭证持有人的风险;因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险;存托凭证持有人权益被摊薄的风险;存托凭证退市的风险;已在境外上市的基础证券发行人,在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险;境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

## 六、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险



本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

## 第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后按规定在指定媒介公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

4、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 5、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

6、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限可相应顺延。

#### **四、清算费用**

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

#### **五、基金财产清算剩余资产的分配**

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### **六、基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具备证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### **七、基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第十九部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人的权利、义务

#### （一）基金份额持有人的权利与义务

基金投资人持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资人自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- （1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资人的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回与转换申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户和定期定额投资等业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，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、谨慎勤勉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) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产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；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、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，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 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；

(12) 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》及其他有关法律法规或监管机构另有规定或要求外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但向监管机构、司法机关或因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；



(13) 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；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 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；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资人能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(18) 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；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(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合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 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；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资人的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券/期货账户等投资所需账户、为基金办理证券/期货交易资金清算。

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券/期货账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关法律法规或监管机构另有规定或要求外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但向监管机构、司法机关或因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(15) 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管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 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；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《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管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

(一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，但法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；
- (12) 单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取和其他应由基金承担的费用；
- (2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- (3) 调整有关基金认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务的规则；
- (4) 增加、减少或调整基金份额类别设置及对基金份额分类办法、规则进行调整；
- (5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(6) 因相应的法律法规、上海证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(7) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

(8) 履行相关程序后，基金推出新业务或服务；

(9) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### （三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前30日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

- （1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；



(2) 经核对, 汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示, 有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一)。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一, 召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内, 就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面方式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时, 通讯开会的方式视为有效:

(1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后, 在2个工作日内连续公布相关提示性公告;

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人, 则为基金管理人)到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人, 则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见; 基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的, 不影响表决效力;

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的, 基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一); 若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一, 召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内, 就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见;

(4) 上述第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人, 同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定, 并与基金登记机构记录相符。

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

###### （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

#### （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有同等表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规、监管机构另有规定或基金合同另有约定外，转换基金运作方式、本基金与其他基金合并、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资人身份文件的表决视为有效出席的投资人，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

#### （七）计票

##### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## (八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起按规定在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人及基金托管人根据新颁布的法律法规或监管规则协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 三、基金收益分配原则、执行方式

### (一) 基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### (二) 基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### (三) 基金收益分配原则

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在与基金托管人协商一致，并按照监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日在指定媒介公告。

#### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，按规定在指定媒介公告。

#### （六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。对于场内份额，遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

### 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、基金上市费用及年费；

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，法律法规、中国证监会另有规定的除外；

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券/期货交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、基金相关账户的开户及维护费用；

10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；

11、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）封闭运作期内基金费用计提方法、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 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金托管人按照与基金管理人核对一致的数据，通过与基金管理人协商一致的方式自动于次月前 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、公休日等，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 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金托管人按照与基金管理人核对一致的数据，通过与基金管理人协商一致的方式自动于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—11 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）封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后的基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金托管人按照与基金管理人核对一致的数据，通过与基金管理人协商一致的方式自动于次月前 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、公休日等，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 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金托管人按照与基金管理人核对一致的数据，通过与基金管理人协商一致的方式自动于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类中第 3—11 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。

（四）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。

（五）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。

## 五、基金财产的投资范围和投资限制

### （一）封闭运作期内的投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场互联互通机制下允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债、次级债等）、股指期货、国债期货、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、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相关规定）。

在封闭运作期内，投资股票资产占基金资产的比例为 0%—100%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%—50%，其中，投资于本基金界定的科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除国债期货和股指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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股票投资部分可以以战略配售的方式进行投资。

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。

### （二）封闭运作期内的投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）封闭运作期内，本基金投资股票资产占基金资产的比例为 0%—100%，其中，投资于本基金界定的科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%—50%；

（2）本基金持有一家公司发行的证券，其市值（若同时持有一家公司发行的 A 股和 H 股，则为 A 股与 H 股合计市值）不超过基金资产净值的 10%；

（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券（若同时持有一家公司发行的 A 股和 H 股，则为 A 股与 H 股合计市值）的 10%；

(4) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

(6) 本基金在封闭运作期内总资产不得超过基金净资产的200%；

(7) 本基金参与股指期货、国债期货投资的，应遵循下列限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

2) 在任何交易日日终，本基金持有的买入股指期货和国债期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

4) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

5) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合本基金合同关于股票投资比例的有关规定；

6) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；

7) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；

8) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；

9) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

(8) 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。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(9) 基金参与融资业务后，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

(10) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(8)条情形之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

(三) 封闭运作期届满后，本基金转为“博时科创主题灵活配置混合型证券投资基金”，基金的投资详见《基金合同》“基金的投资”章节的第七部分。

## 六、基金资产估值

### (一) 估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### (二) 估值对象

基金所拥有的股票、债券、衍生工具和其他投资等持续以公允价值计量的金融资产及负债。

### (三) 估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本合同另有约定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人共同确定；

(3) 交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值。

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市或未挂牌转让的股票、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

5、本基金投资股指期货合约、国债期货合约，按估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、汇率：本基金外币资产价值计算中，涉及主要货币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准；涉及到其它币种与人民币之间的汇率，参照数据服务商提供的当日各种货币兑美元折算率采用套算的方法进行折算。

7、当基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

8、如有确凿证据表明按原有方法进行估值不能客观反映上述资产或负债公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

9、相关法律法规以及监管部门、自律规则另有规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。



如本基金转为“博时科创主题灵活配置混合型证券投资基金”，投资品种新增事项的估值方法遵照相关法律法规以及监管部门的规定，并相应更新。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值的计算结果对外予以公布。

#### （四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### （五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人、基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

(六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金应当暂停估值；

4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(七) 基金净值的确认

基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值按规定予以公布。

(八) 特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、指数编制机构及登记结算公司等机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资

产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 七、基金合同变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后按规定在指定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

4、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 5、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

6、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限可相应顺延。

#### (四) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

#### (五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### (六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具备证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

## 九、基金合同的效力

《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续,并经中国证监会书面确认后生效。

2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、《基金合同》自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。

4、《基金合同》正本一式六份,除上报有关监管机构一式二份外,基金管理人、基金托管人各持有二份,每份具有同等的法律效力。

5、《基金合同》可印制成册,供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。



## 第二十部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：博时基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层

邮政编码：518017

法定代表人：江向阳

设立日期：1998 年 7 月 13 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【1998】26 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.5 亿元人民币

存续期限：持续经营

#### （二）基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：陈四清

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：洪渊

成立时间：1984 年 1 月 1 日

基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》

（国发[1983]146 号）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

A. 封闭运作期届满前“博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金”的投资范围：

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场互联互通机制下允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债、次级债等）、股指期货、国债期货、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、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相关规定）。

基金的投资组合比例为：投资股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为 0%—100%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%—50%，其中，投资于本基金界定的科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除国债期货和股指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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股票投资部分可以以战略配售的方式进行投资。

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。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

B. 封闭运作期届满转为“博时科创主题灵活配置混合型证券投资基金”后的投资范围：

本基金投资于国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场互联互通机制下允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债、次级债等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、国债期货、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（含存托凭证）投资比例为基金资产的 0%–95%；投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%–50%；每个交易日日终，在扣除国债期货和股指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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

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。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

A. 封闭运作期届满前“博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金”的投资限制：

（1）在封闭运作期内，投资股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为 0%—100%，其中，投资于本基金界定的科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%–50%；

(2) 本基金持有一家公司发行的证券（含存托凭证），其市值（若同时持有一家公司发行的A股和H股，则为A股与H股合计市值）不超过基金资产净值的10%；

(3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（含存托凭证），不超过该证券（若同时持有一家公司发行的A股和H股，则为A股与H股合计市值）的10%；

(4) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

(6) 本基金在封闭运作期内总资产不得超过基金净资产的200%；

(7) 本基金参与股指期货、国债期货投资的，应遵循下列限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

2) 在任何交易日日终，本基金持有的买入股指期货和国债期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

4) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

5) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关规定；

6) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；

7) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；

8) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；

9) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

(8) 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。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(9) 基金参与融资业务后，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(10) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(8)条情形之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于托管人实施交易监督。

对于因法律法规变化导致本基金投资范围及投资限制调整的，基金管理人应提前通知基金托管人，经基金托管人书面同意后方可纳入投资监督范围。基金管理人知晓基金托管人投资监督职责的履行受外部数据来源或系统开发等因素影响，基金管理人应为托管人系统调整预留所需的合理必要时间。

#### B. 封闭运作期届满转为“博时科创主题灵活配置混合型证券投资基金”后的投资限制：

(1) 本基金股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%，投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%—50%；

(2) 每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值（若同时持有一家公司发行的 A 股和 H 股，则为 A 股与 H 股合计市值）不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券（若同时持有一家公司发行的 A 股和 H 股，则为 A 股与 H 股合计市值）的 10%；

(5) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(6) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(7) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(10) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15) 本基金参与股指期货、国债期货投资的，应遵循下列限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；



2) 在任何交易日日终, 本基金持有的买入股指期货和国债期货合约价值和有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%; 其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

3) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;

4) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;

5) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关规定;

6) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入国债期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 15%;

7) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;

8) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%;

9) 本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

(16) 本基金在总资产不得超过基金净资产的 140%;

(17) 基金参与融资业务后, 在任何交易日日终, 持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%;

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(6)、(7)、(12)项另有约定外, 因证券/期货市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自封闭运作期届满转为上市开放式基金(LOF)之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内, 本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前2个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于托管人实施交易监督。

对于因法律法规变化导致本基金投资范围及投资限制调整的，基金管理人应提前通知基金托管人，经基金托管人书面同意后方可纳入投资监督范围。基金管理人知晓基金托管人投资监督职责的履行受外部数据来源或系统开发等因素影响，基金管理人应为托管人系统调整预留所需的合理必要时间。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资。

法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资可不受上述规定的限制或按变更后的规定执行。

4、基金托管人依据以下约定对基金管理人参与银行间债券市场投资进行监督。

基金管理人参与银行间市场交易，应按照审慎的风险控制原则评估交易对手资信风险，并自主选择交易对手。基金托管人发现基金管理人与银行间市场的丙类会员进行债券交易的，可以通过邮件、电话等双方认可的方式提醒基金管理人，基金管理人应及时向基金托管人提供可行性说明。基金管理人应确保可行性说明内容真实、准确、完整。基金托管人不对基金管理人提供的可行性说明进行实质审查。基金管理人同意，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，以DVP(券款兑付)的交易结算方式进行交易。

5、关于银行存款投资。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。基金管理人应基于审慎原则评估存款银行信用风险并据此选择存款银行。因基金管理人违反上述原则给基金造成的损失，基金托管人不承担任何责任，相关损失由基金管理人先行承担。基金管理人履行先行赔付责任后，有权要求相关责任人进行赔偿。基金托管人的职责仅限于督促基金管理人履行先行赔付责任。

#### 6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

(2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

(3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

(4) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

(5) 基金托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定，对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部

门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

(二)基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议有关规定时，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在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

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。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反有关法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，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规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，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存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，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、基金管理人对基金托管人的业务核查

基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时,基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正,基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正,并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构,同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由,拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理人应报告中国证监会。

### 四、基金财产保管

#### (一) 基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令,不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户,与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理,确保基金财产的完整与独立。



5、对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人予以必要的协助配合，但对此不承担责任。

#### （二）募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的博时基金管理有限公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满或停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

#### （三）基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

#### （四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。



基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

#### （五）债券托管账户的开立和管理

1、《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

2、基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间债券市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### （六）其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### （七）基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或银行间市场清算所股份有限公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件

送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件或复印件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

## 五、基金资产净值计算和会计核算

### （一）基金资产净值的计算

#### 1、基金资产净值的计算、复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。

基金管理人应每个工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值、基金份额净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金净值。因此，本基金的会计责任方是基金管理人，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对外公布的基金净值的计算结果予以公布。法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

### （二）基金资产估值方法

#### 1、估值对象

基金所拥有的股票、债券、衍生工具和其他投资等持续以公允价值计量的金融资产及负债。

#### 2、估值方法

本基金的估值方法为：

##### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

A. 交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

B. 交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有约定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人共同确定；

C. 交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值。

D. 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

A. 送股、转增股、配股和公开增发的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

B. 首次公开发行未上市或未挂牌转让的股票、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

C. 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回

售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

(4) 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

(5) 本基金投资股指期货合约、国债期货合约，按估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(6) 当基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

(7) 汇率：本基金外币资产价值计算中，涉及主要货币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准；涉及到其它币种与人民币之间的汇率，参照数据服务商提供的当日各种货币兑美元折算率采用套算的方法进行折算。

(8) 如有确凿证据表明按原有方法进行估值不能客观反映上述资产或负债公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

(9) 相关法律法规以及监管部门、自律规则另有规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如本基金转为“博时科创主题灵活配置混合型证券投资基金”，投资品种新增事项的估值方法遵照相关法律法规以及监管部门的规定，并相应更新。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

### （三）估值差错处理

因基金估值错误给投资者造成损失的应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

当基金管理人计算的基金净值信息已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基

金支付的赔偿金额,由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误,另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误,进而导致基金资产净值、基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失,以及由此造成以后交易日基金资产净值、基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失,由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于不可抗力原因,或由于证券交易所、期货交易所、指数编制机构或登记结算公司等机构发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人应当免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

当基金管理人计算的基金净值与基金托管人的计算结果不一致时,相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对,如果最后仍无法达成一致,应以基金管理人的计算结果为准对外公布,由此造成的损失以及因该交易日基金净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任,基金托管人不负赔偿责任。

#### (四) 基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后,应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则,分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册,对相关各方各自的账册定期进行核对,互相监督,以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧,应以基金管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的,基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正,保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符,暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值的计算和公告的,以基金管理人的账册为准。

#### (五) 基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制,应于每月终了后 5 个工作日内完成。

《基金合同》生效后,基金招募说明书、基金产品资料概要的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金招募说明书和基金产品资料概要并登载在指定网站上;基金招募说明书、基金产品资料概要其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一



次。基金终止运作的，基金管理人不再更新招募说明书、基金产品资料概要。基金管理人在每个季度结束之日起15个工作日内完成季度报告编制并公告；在会计年度半年终了后两个月内完成中期报告编制并公告；在会计年度结束后三个月内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在5个工作日内完成月度报告，在月度报告完成当日，对报告加盖公章后，以加密传真方式将有关报告提供基金托管人复核；基金托管人在3个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在7个工作日内完成季度报告，在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后7个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在30日内完成中期报告，在中期报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后30日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在45日内完成年度报告，在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后45日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。基金份额登记机构的保存期限自基金账户销户之日起不得少于20年。法律法规或监管部门另有规定的除外。



基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年6月30日、每年12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为15年，法律法规或监管部门另有规定的除外。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、争议解决方式

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京市，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律（为本协议之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

## 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更与终止

#### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更须报中国证监会备案。

#### 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；

- (3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；
- (4) 发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

## (二) 基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和本托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

4、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

### 5、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

### 6、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

### 7、基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### (三) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

### (四) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第二十一部分 对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、基金销售机构提供。基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目，主要服务内容如下：

### 一、持有人交易资料的寄送服务

#### 1、交易确认单

基金合同生效后正常开放期，每次交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询和打印交易确认单，或在 T+1 个工作日后通过博时一线通电话、博时网站查询交易确认情况。基金管理人向投资者寄送交易确认单。

#### 2、电子对账单

每月结束后，基金管理人向所有订阅电子邮件对账单的投资者发送电子邮件对账单。

投资者可以登录基金管理人网站（<http://www.bosera.com>）自助订阅；或发送“订阅电子对账单”邮件到客服邮箱 [service@bosera.com](mailto:service@bosera.com)；也可直接拨打博时一线通 95105568（免长途话费）订阅。

3、由于投资者提供的电子邮箱不详、错误、未及时变更或通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资者，敬请及时通过本基金管理人网站，或拨打博时一线通客服电话查询、核对、变更您的预留联系方式。

### 二、网上理财服务

通过基金管理人网站，投资者可获得如下服务：

#### 1、自助开户交易

投资者可登录基金管理人网站网上交易系统，与本公司达成电子交易的相关协议，接受本公司有关服务条款并办理相关手续后，即可自助开户并进行网上交易，如基金认/申购、定投、转换、赎回、赎回转申购及分红方式变更等。具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。

#### 2、查询服务

投资者可以通过基金管理人网站查询所持有基金的基金份额、交易记录等信息，同时可以修改基金账户信息等基本资料。

#### 3、信息资讯服务

投资者可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管理人最新动态、热点问题等。

#### 4、在线客服

投资者可以通过基金管理人网站首页“在线客服”功能进行在线咨询。也可以在“您问我答”栏目中，直接提出有关本基金的问题和建议。

### 三、短信服务

基金管理人向订制短信服务的基金份额持有人提供相应短信服务。

### 四、电子邮件服务

基金管理人为投资者提供电子邮件方式的业务咨询、投诉受理、基金份额净值等服务。

### 五、手机理财服务

投资者通过手机博时移动版直销网上交易系统 (<http://m.bosera.com>) 和博时 App 版直销网上交易系统，可以使用基金理财所需的基金交易、理财查询、账户管理、信息资讯等功能和服务。

### 六、信息订阅服务

投资者可以通过基金管理人网站、客服中心提交信息订制的申请，基金管理人将以电子邮件、手机短信的形式定期为投资者发送所订制的信息。

### 七、电话理财服务

投资者拨打博时一线通：95105568（免长途话费）可享有投资理财交易的一站式综合服务：

1、自助语音服务：基金管理人自助语音系统提供 7×24 小时的全天候服务，投资者可以自助查询账户余额、交易情况、基金净值等信息，也可以进行直销交易、密码修改、传真索取等操作。

2、电话交易服务：本公司直销投资者可通过博时一线通电话交易平台在线办理基金的赎回、变更分红方式、撤单等直销交易业务。

3、人工电话服务：投资者可以获得业务咨询、信息查询、资料修改、投诉受理、信息订制、账户诊断等服务。

4、电话留言服务：非人工服务时间或线路繁忙时，投资者可进行电话留言。

### 八、基金管理人联系方式

公司网址：[www.bosera.com](http://www.bosera.com)

电子信箱: [service@bosera.com](mailto:service@bosera.com)

博时一线通客服电话: 95105568 (免长途话费)

九、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容, 请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前, 您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。



## 第二十二部分 其他应披露的事项

(一)、 2020年08月31日, 我公司公告了《博时科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金2020年中期报告》;

(二)、 2020年08月27日, 我公司公告了《博时科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新》;

(三)、 2020年08月05日, 我公司公告了《博时基金管理有限公司关于暂停使用通联支付提供的中信银行、中国银行快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告》;

(四)、 2020年07月23日, 我公司公告了《博时基金管理有限公司关于暂停使用中国农业银行非快捷支付服务办理直销网上交易部分业务的公告》;

(五)、 2020年07月21日, 我公司公告了《博时科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金2020年第2季度报告》;

(六)、 2020年07月09日, 我公司公告了《博时基金管理有限公司关于暂停使用上海银联提供的光大银行通道办理直销网上交易部分业务的公告》;

(七)、 2020年06月29日, 我公司公告了《博时基金管理有限公司关于暂停使用中国银行理财直付服务办理直销网上交易部分业务的公告》、《博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告》;

(八)、 2020年06月01日, 我公司公告了《关于博时旗下部分基金参加招商银行申购及定投业务费率优惠活动的公告》;

(九)、 2020年04月22日, 我公司公告了《博时科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金2020年第1季度报告》;

(十)、 2020年04月17日, 我公司公告了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》;

(十一)、 2020年03月27日, 我公司公告了《博时科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金2019年年度报告》;

(十二)、 2020年01月28日, 我公司公告了《博时基金管理有限公司关于2020年春节假期延长期间暂停办理申购赎回等业务的公告》;

(十三)、 2020年01月17日, 我公司公告了《博时科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金2019年第4季度报告》;

(十四)、 2019 年 12 月 31 日，我公司公告了《博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（摘要）》、《博时基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金法律文件的公告》、《博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

(十五)、 2019 年 12 月 23 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金开通跨系统转托管业务的公告》、《博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金上市交易公告书提示性公告》、《博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金-上市交易公告书》。

## 第二十三部分 招募说明书存放及查阅方式

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。投资人也可按工本费购买本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 第二十四部分 备查文件

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件
- 2、《博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、注册登记协议
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 8、中国证监会要求的其他文件

博时基金管理有限公司

2020 年 10 月 14 日