

# 博时睿益事件驱动灵活配置混合型证券投资基金基金

## 更新招募说明书摘要 2018 年第 1 号

### (摘要)

#### 【重要提示】

1、本基金根据2016年3月18日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予博时睿益定增灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]564号）进行募集。

2、基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

3、投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行负担。

4、本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在

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

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

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

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

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

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

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

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

5%。权证投资比例不得超过基金资产净值的3%。

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

9、基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

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

11、本招募说明书（更新）所载内容截止日为2018年2月19日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年12月31日（财务数据未经审计）。

## 一、基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称： 博时基金管理有限公司

住所： 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

办公地址： 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

法定代表人： 张光华

成立时间： 1998 年 7 月 13 日

注册资本： 2.5 亿元人民币

存续期间： 持续经营

联系人： 韩强

联系电话： （0755） 8316 9999

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准设立。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份 49%；中国长城资产管理公司，持有股份 25%；天津港（集团）有限公司，持有股份 6%；上海汇华实业有限公司，持有股份 12%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份 6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份 2%。注册资本为 2.5 亿元人民币。

公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设两大总部和二十九个直属部门，分别是：权益投资总部、固定收益总部以及宏观策略部、交易部、指数与量化投资部、特定资产管理部、多元资产管理部、年金投资部、绝对收益投资部、产品规划部、营销服务部、客户服务中心、市场部、养老金业务中心、战略客户部、机构-上海、机构-南方、券商业务部、零售-北京、零售-上海、零售-南方、央企业务部、互联网金融部、董事会办公室、办公室、人力资源部、财务部、信息技术部、基

金运作部、风险管理部和监察法律部。

权益投资总部负责公司所管理资产的权益投资管理及相关工作。权益投资总部下设股票投资部（含各投资风格小组）、研究部。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。研究部负责完成对宏观经济、投资策略、行业上市公司及市场的研究。固定收益总部负责公司所管理资产的固定收益投资管理及相关工作。固定收益总部下设现金管理组、公募基金组、专户组、国际组和研究组，分别负责各类固定收益资产的研究和投资工作。

市场部负责公司市场和销售管理、销售组织、目标和费用管理、销售督导与营销培训管理、公司零售渠道银行总行管理与维护、推动金融同业业务合作与拓展、国际业务的推动与协作等工作。战略客户部负责北方地区由国资委和财政部直接管辖企业以及该区域机构客户的销售与服务工作。机构-上海和机构-南方分别主要负责华东地区、华南地区以及其他指定区域的机构客户销售与服务工作。养老金业务中心负责公司社保基金、企业年金、基本养老金及职业年金的客户拓展、销售与服务、养老金研究与政策咨询、养老金销售支持与中台运作协调、相关信息服务等工作。券商业务部负责券商渠道的开拓和销售服务。零售-北京、零售-上海、零售-南方负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。央企业务部负责招商局集团签约机构客户、重要中央企业及其财务公司等客户的拓展、合作业务落地与服务等工作。营销服务部负责营销策划、销售支持、品牌传播、对外媒体宣传等工作。

宏观策略部负责为投委会审定资产配置计划提供宏观研究和策略研究支持。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。指数与量化投资部负责公司各类指数与量化投资产品的研究和投资管理工作。特定资产管理部负责公司权益类特定资产专户和权益类社保投资组合的投资管理及相关工作。多元资产管理部负责公司的基金中基金投资产品的研究和投资管理工作。年金投资部负责公司所管理企业年金等养老金资产的投资管理及相关工作。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等工作。互联网金融部负责公司互联网金融战略规划的设计和实施，公司互联网金融的平台建设、业务拓展和客户运营，推动公司相关业务在互联网平台的整合与创新。客户服务中心负责零售客户的服务和咨询工作。

董事会办公室专门负责股东会、董事会、监事会及董事会各专业委员会各项会务工作；股东关系管理与董、监事的联络、沟通及服务；基金行业政策、公司治理、战略发展研究、公司文化建设；与公司治理及发展战略等相关的重大信息披露管理；政府公共关系管理；党务工作；博时慈善基金会的管理及运营等。办公室负责公司的行政后勤支持、会议及文件管理、外事活动管理、档案管理及工会工作等。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与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察，并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。

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

截止到 2017 年 12 月 31 日，公司总人数为 527 人，其中研究员和基金经理超过 89% 拥有硕士及以上学位。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

## 二、主要成员情况

### 1、基金管理人董事会成员

张光华先生，博士，董事长。历任国家外汇管理局政研室副主任，计划处处长，中国人民银行海南省分行副行长、党委委员，中国人民银行广州分行副行长、党委副书记，广东发展银行行长、党委副书记，招商银行副行长、执行董事、副董事长、党委副书记，在招商银行任职期间曾兼任永隆银行副董事长、招商基金管理有限公司董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长、招银国际金融有限公司董事长、招银金融租赁有限公司董事长。2015 年 8 月起，任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人。

江向阳先生，董事。2015 年 7 月起任博时基金管理有限公司总经理。中共党员，南开大学国际金融博士，清华大学金融媒体 EMBA。1986-1990 年就读于北京师范大学信息与情报学系，获学士学位；1994-1997 年就读于中国政法大学研究生院，获法学硕士学位；2003-2006 年，就读于南开大学国际经济研究所，获国际金融博士学位。2015 年 1 月至 7 月，任招商局金融集团副总经理、博时基金管理有限公司党委副书记。历任中国证监会办公厅、党办副主任兼新闻办（网信办）主任；中国证监会办公厅副巡视员；中国证监会深圳专员办处长、副专员；中国证监会期货监管部副处长、处长；中国农业工程研究设计院情报室干部。

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

年 6 月起担任长城证券股份有限公司董事；自 2015 年 3 月起担任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司董事；自 2016 年 4 月起担任招商局金融集团有限公司副总经理。

王金宝先生，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。

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

顾立基先生，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

车晓昕女士，硕士，监事。1983 年起历任郑州航空工业管理学院助教、讲师、珠海证券有限公司经理、招商证券股份有限公司投资银行总部总经理。现任招商证券股份有限公司财务管理董事总经理。2008 年 7 月起，任博时基金管理有限公司第四至六届监事会监事。

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

长城资产管理股份有限公司机构协同部专职董监事。2017 年 6 月起任博时基金管理有限公司监事。

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

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

黄健斌先生，工商管理硕士。1995 年起先后在广发证券有限公司、广发基金管理有限责任公司投资管理部、中银国际基金管理有限公司基金管理部工作。2005 年加入博时基金管理公司，历任固定收益部基金经理、博时平衡配置混合型基金基金经理、固定收益部副总经理、社保组合投资经理、固定收益部总经理。现任公司总经理助理兼固定收益总部董事总经理、年金投资部总经理、社保组合投资经理、高级投资经理、兼任博时资本管理有限公司董事。2016 年 3 月 18 日至今担任博时基金管理有限公司监事会员工监事。

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

### 3、高级管理人员

张光华先生，简历同上。

江向阳先生，简历同上。

王德英先生，硕士，副总经理。1995 年起先后在北京清华计算机公司任开发部经理、清华紫光股份公司 CAD 与信息事业部任总工程师。2000 年加入博时基金管理有限公司，历任行政管理部副经理，电脑部副经理、信息技术部总经理、公司代总经理。现任公司副总经理，主管 IT、运作、指数与量化投资等工作，博时基金(国际)有限公司及博时资本管理有限公司董事。

董良泓先生，CFA，MBA，副总经理。1993 年起先后在中国技术进出口总公司、中技上海投资公司、融通基金管理有限公司、长城基金管理有限公司从事投资管理工作。2005 年 2 月加入博时基金管理有限公司，历任社保股票基金经理，特定资产高级投资经理，研究部总经理兼特定资产高级投资经理、社保股票基金经理、特定资产管理部总经理、博时资本管理有限公司董事。现任公司副总经理兼高级投资经理、社保组合投资经理，兼任博时基金（国际）有限公司董事。

邵凯先生，经济学硕士，副总经理。1997 年至 1999 年在河北省经济开发投资公司从事投资管理工作。2000 年 8 月加入博时基金管理有限公司，历任债券组合经理助理、债券组合经理、社保债券基金基金经理、固定收益部副总经理兼社保债券基金基金经理、固定收益部总经理、固定收益投资总监、社保组合投资经理。现任公司副总经理、兼任博时基金（国际）有限公司董事、博时资本管理有限公司董事。

徐卫先生，硕士，副总经理。1993 年起先后在深圳市证券管理办公室、中国证监会、摩根士丹利华鑫基金工作。2015 年 6 月加入博时基金管理有限公司，现任公司副总经理兼博时资本管理有限公司董事、博时基金(国际)有限公司董事。

孙麒清女士，商法学硕士，督察长。曾供职于广东深港律师事务所。2002 年加入博时基金管理有限公司，历任监察法律部法律顾问、监察法律部总经理。现任公司督察长，兼任博时基金（国际）有限公司董事、博时资本管理有限公司副董事长。

#### 4、本基金基金经理

陈鹏扬先生，硕士。2008 年至 2012 年在中金公司工作。2012 年加入博时基金管理有限公司，历任研究员、资深研究员、投资经理、博时睿远定增混合基金（2016.4.15–2017.10.16）、博时睿利定增混合基金（2016.5.31–2017.12.1）、博时睿益定增混合基金（2016.8.19–2018.2.22）的基金经理。现任博时裕隆混合基金（2015.8.24–至今）兼博时弘盈定期开放混合基金（2016.8.1–至今）、博时弘裕 18 个月定开债基金（2016.8.30–至今）、博时弘泰定期开放混合基金（2016.12.9–至今）、博时睿丰定开混合基金（2017.3.22–至今）、博时弘康 18 个月定开债基金（2017.3.24–至今）、博时睿远事件驱动混合（LOF）基金（2017.10.17–至今）、博时睿利事件驱动混合（LOF）基金（2017.12.4–至今）、博时睿益事件驱动混合（LOF）基金（2018.2.23–至今）的基金经理。

金晟哲先生，硕士。2012 年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、资深研究员、博时睿利定增混合基金（2017.2.28–2017.12.1）、博时睿益定增混合基金（2017.2.28–2018.2.22）的基金经理。现任研究部副总经理兼博时鑫泽混合基金（2016.10.24–至今）、博时睿丰定开混合基金（2017.3.22–至今）、博时价值增长混合基金（2017.11.13–至今）、博时睿利事件驱动混合（LOF）基金（2017.12.4–至今）、博时睿益事件驱动混合（LOF）基金（2018.2.23–至今）的基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

委员：江向阳、邵凯、黄健斌、李权胜、欧阳凡、魏凤春、王俊、过钧、白仲光

江向阳先生，简历同上。

邵凯先生，简历同上。

黄健斌先生，简历同上。

李权胜先生，硕士。1994 年至 1998 年在北京大学生命科学学院学习，获理学学士学位。1998 年至 2001 年继续就读于北京大学，获理学硕士学位。2013 年至 2015 年就读清华大学-

香港中文大学金融 MBA 项目，获得香港中文大学 MBA 学位。2001 年 7 月至 2003 年 12 月在招商证券研发中心工作，任研究员；2003 年 12 月至 2006 年 2 月在银华基金工作，任基金经理助理。2006 年 3 月加入博时基金管理有限公司，任研究员。2007 年 3 月起任研究部研究员兼任博时精选股票基金经理助理。2008 年 2 月调任特定资产管理部投资经理。2012 年 8 月至 2014 年 12 月担任博时医疗保健行业股票型证券投资基金基金经理。2013 年 12 月开始担任博时精选混合型证券投资基金基金经理。现任博时基金权益投资总部董事总经理兼股票投资部总经理，权益投资价值组负责人，公司投资决策委员会成员。

欧阳凡先生，硕士。2003 年起先后在衡阳市金杯电缆厂、南方基金工作。2011 年加入博时基金管理有限公司，曾任特定资产管理部副总经理、社保组合投资经理助理。现任特定资产管理部总经理兼社保组合投资经理。

魏凤春先生，经济学博士。1993 年起先后在山东经济学院、江南证券、清华大学、江南证券、中信建投证券公司工作。2011 年加入博时基金管理有限公司，历任投资经理、博时抗通胀增强回报（QDII-FOF）基金、博时平衡配置混合基金的基金经理。现任首席宏观策略分析师兼宏观策略部总经理、多元资产管理部总经理。

王俊先生，硕士，CFA。2008 年从上海交通大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、金融地产与公用事业组组长、研究部副总经理、博时国企改革股票基金、博时丝路主题股票基金的基金经理。现任研究部总经理兼博时主题行业混合（LOF）基金、博时沪港深优质企业混合基金、博时沪港深成长企业混合基金、博时沪港深价值优选混合基金、博时新兴消费主题混合基金的基金经理。

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

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

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、 基金托管人

### 一、基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

成立日期：1992 年 6 月 18 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：466.79095 亿元人民币

法定代表人：唐双宁

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75 号

投资与托管业务部总经理：曾闻学

电话：(010) 63636363

传真：(010) 63639132

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

### 二、投资与托管业务部部门及主要人员情况

行长张金良先生，曾任中国银行财会部会计制度处副处长、处长、副总经理兼任 IT 蓝图实施办公室主任、总经理，中国银行北京市分行行长、党委书记，中国银行副行长、党委委员。现任中国光大集团股份公司执行董事、党委委员，兼任中国光大银行执行董事、行长、党委副书记。

曾闻学先生，曾任中国光大银行办公室副总经理，中国光大银行北京分行副行长。现任中国光大银行股份有限公司投资与托管业务部总经理。

### 三、证券投资基金托管情况

截至 2017 年 12 月 31 日，中国光大银行股份有限公司托管华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金等共 93 只证券投资基金，托管基金资产规模 2014.52 亿元。同时，开展了证券公司资产管理计划、专户理财、企业年金基金、QDII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

## 四、托管业务的内部控制制度

### 1、内部控制目标

确保有关法律法规在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金托管人有关基金托管的各项管理制度和业务操作规程在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金财产安全；保证基金托管业务稳健运行；保护基金份额持有人、基金管理公司及基金托管人的合法权益。

### 2、内部控制的原则

(1) 全面性原则。内部控制必须渗透到基金托管业务的各个操作环节，覆盖所有的岗位，不留任何死角。

(2) 预防性原则。树立“预防为主”的管理理念，从风险发生的源头加强内部控制，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。

(3) 及时性原则。建立健全各项规章制度，采取有效措施加强内部控制。发现问题，及时处理，堵塞漏洞。

(4) 独立性原则。基金托管业务内部控制机构独立于基金托管业务执行机构，业务操作人员和内控人员分开，以保证内控机构的工作不受干扰。

### 3、内部控制组织结构

中国光大银行股份有限公司董事会下设风险管理委员会、审计委员会，委员会委员由相关部门的负责人担任，工作重点是对总行各部门、各类业务的风险和内控进行监督、管理和协调，建立横向的内控管理制约体制。各部门负责分管系统内的内部控制的组织实施，建立纵向的内控管理制约体制。投资与托管业务部建立了严密的内控督察体系，设立了风险管理处，负责证券投资基金管理业务的风险管理。

### 4、内部控制制度

中国光大银行股份有限公司投资与托管业务部自成立以来严格遵照《基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》等法律、法规的要求，并根据相关法律法规制订、完善了《中国光大银行证券投资基金管理业务内部控制规定》、《中国光大银行投资与托管业务部保密规定》等十余项规章制度和实施细则，将风险控制落实到每一个工作环节。中国光大银行投资与托管业务部以控制和防范基金托管业务风险为主线，在重要岗位（基金清算、基金核算、监督稽核）还建立了安全保密区，安装了录像监视系统和录音监听系统，以保障基金信息的安全。

## 五、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据法律、法规和基金合同等的要求，基金托管人主要通过定性和定量相结合、事前监督和事后控制相结合、技术与人工监督相结合等方式方法，对基金投资品种、投资组合比例

每日进行监督；同时，对基金管理人就基金资产净值的计算、基金管理人和基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配、基金费用支付等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反法律、法规和基金合同等规定的行为，及时以书面或电话形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。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。

### 三、 相关服务机构

#### 一、基金份额发售机构

##### 1、直销机构

博时基金管理有限公司北京分公司及北京直销中心

名称:	博时基金管理有限公司北京直销中心
地址:	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层
电话:	010-65187055
传真:	010-65187032、010-65187592
联系人:	韩明亮
博时一线通:	95105568（免长途话费）

##### 2、代销机构

###### (1)交通银行股份有限公司

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

###### (2)上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址:	上海市中山东一路 12 号
办公地址:	上海市北京东路 689 号东银大厦 25 楼
法定代表人:	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>

**(3) 中国光大银行股份有限公司**

注册地址:	北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦
办公地址:	北京市西城区太平桥大街 25 号光大中心
法定代表人:	唐双宁
联系人:	朱红
电话:	010-63636153
传真:	010-63636157
客户服务电话:	95595
网址:	<a href="http://www.cebbank.com/">http://www.cebbank.com/</a>

**(4) 中国民生银行股份有限公司**

注册地址:	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址:	北京市西城区复兴门内大街 2 号
法定代表人:	洪崎
联系人:	王继伟
电话:	010-58560666
传真:	010-57092611
客户服务电话:	95568
网址:	<a href="http://www.cmbc.com.cn/">http://www.cmbc.com.cn/</a>

**(5) 华夏银行股份有限公司**

注册地址:	北京市东城区建国门内大街 22 号
办公地址:	北京市东城区建国门内大街 22 号
法定代表人:	吴建
联系人:	郑鹏
电话:	010-85238667
传真:	010-85238680
客户服务电话:	95577
网址:	<a href="http://www.hxb.com.cn/">http://www.hxb.com.cn/</a>

**(6) 上海银行股份有限公司**

注册地址:	上海市浦东新区银城中路 168 号
办公地址:	上海市浦东新区银城中路 168 号
法定代表人:	范一飞
联系人:	汤征程
电话:	021-68475521
传真:	021-68476497
客户服务电话:	95594
网址:	<a href="http://www.bosc.cn">www.bosc.cn</a>

**(7) 平安银行股份有限公司**

注册地址:	深圳市深南东路 5047 号
办公地址:	深圳市深南东路 5047 号
法定代表人:	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>

**(8) 上海农村商业银行股份有限公司**

注册地址:	上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼
办公地址:	上海市浦东新区银城中路 8 号 15-20 楼、22-27 楼
法定代表人:	冀光恒
联系人:	施传荣
电话:	021-38576666
传真:	021-50105124
客户服务电话:	021-962999;4006962999
网址:	<a href="http://www.srcb.com/">http://www.srcb.com/</a>

**(9) 东莞银行股份有限公司**

注册地址:	东莞市莞城区体育路 21 号
办公地址:	东莞市莞城区体育路 21 号
法定代表人:	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>

**(10) 江苏银行股份有限公司**

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

**(11) 东莞农村商业银行股份有限公司**

注册地址:	广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号
-------	-------------------

办公地址:	广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦
法定代表人:	王耀球
联系人:	杨亢
电话:	0769-22866270
传真:	0769-22866282
客户服务电话:	961122
网址:	<a href="http://www.drcbank.com/">http://www.drcbank.com/</a>

**(12) 厦门银行股份有限公司**

注册地址:	厦门湖滨北路 101 号厦门银行大厦
办公地址:	厦门湖滨北路 101 号厦门银行大厦
法定代表人:	吴世群
联系人:	孙瑜
电话:	0592-5310251
传真:	0592-5061952
客户服务电话:	4008588888
网址:	<a href="http://www.xmccb.com/">http://www.xmccb.com/</a>

**(13) 和讯信息科技有限公司**

注册地址:	北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层
办公地址:	北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层
法定代表人:	王莉
联系人:	张紫薇
电话:	0755-82721122-8625
传真:	0755-82029055
客户服务电话:	400-920-0022
网址:	<a href="http://Licaike.hexun.com">http://Licaike.hexun.com</a>

**(14) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司**

注册地址:	上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室
办公地址:	上海浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室
法定代表人:	汪静波
联系人:	方成
电话:	021-38602377
传真:	021-38509777
客户服务电话:	400-821-5399
网址:	<a href="http://www.noah-fund.com">http://www.noah-fund.com</a>

**(15) 深圳众禄金融控股股份有限公司**

注册地址:	深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼
办公地址:	深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼
法定代表人:	薛峰
联系人:	童彩平

电话:	0755-33227950
传真:	0755-33227951
客户服务电话:	400-678-8887
网址:	<a href="https://www.zlfund.cn/">https://www.zlfund.cn/</a> ; <a href="http://www.jjmmw.com">www.jjmmw.com</a>

**(16) 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>

**(17) 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.ehowbuy.com">http://www.ehowbuy.com</a>

**(18) 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>

**(19) 上海长量基金销售投资顾问有限公司**

注册地址:	上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
办公地址:	上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层
法定代表人:	张跃伟
联系人:	敖玲
电话:	021-58788678-8201
传真:	021-58787698
客户服务电话:	400-820-2899
网址:	<a href="http://www.erichfund.com">http://www.erichfund.com</a>

**(20) 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>

**(21) 嘉实财富管理有限公司**

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

**(22) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司**

注册地址:	北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809
办公地址:	北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 18 层 1809
法定代表人:	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>

**(23) 北京恒天明泽基金销售有限公司**

注册地址:	北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号 5 层 5122 室
办公地址:	北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层
法定代表人:	周斌
联系人:	马鹏程
电话:	010-57756074
传真:	010-56810782
客户服务电话:	400-786-8868
网址:	<a href="http://www.chtfund.com">http://www.chtfund.com</a>

**(24) 北京钱景基金销售有限公司**

注册地址:	北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012
-------	---------------------------------

办公地址:	北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012
法定代表人:	赵荣春
联系人:	魏争
电话:	010-57418829
传真:	010-57569671
客户服务电话:	400-893-6885
网址:	<a href="http://www.qianjing.com">www.qianjing.com</a>

**(25) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司**

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:	王岩
联系人:	周君
电话:	010-53570568
传真:	010-59200800
客户服务电话:	400-819-9868
网址:	<a href="http://www.tdyhfund.com">http://www.tdyhfund.com</a>

**(26) 海银基金销售有限公司**

注册地址:	上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元
办公地址:	上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼
法定代表人:	刘惠
联系人:	毛林
电话:	021-80133597
传真:	021-80133413
客户服务电话:	400-808-1016
网址:	<a href="http://www.fundhaiyin.com">www.fundhaiyin.com</a>

**(27) 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:	<a href="http://www.lufunds.com">www.lufunds.com</a>

**(28) 珠海盈米财富管理有限公司**

注册地址:	珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491
办公地址:	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203
法定代表人:	肖雯
联系人:	吴煜浩

电话:	020-89629099
传真:	020-89629011
客户服务电话:	020-80629066
网址:	www.yingmi.cn

**(29) 大连网金基金销售有限公司**

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

**(30) 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:	<a href="http://danjuanapp.com">danjuanapp.com</a>

**(31) 上海华夏财富投资管理有限公司**

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

**(32) 国泰君安证券股份有限公司**

注册地址:	中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号
办公地址:	上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼
法定代表人:	杨德红
联系人:	芮敏祺
电话:	021-38676666
传真:	021-38670161
客户服务电话:	95521
网址:	<a href="http://www.gtja.com">www.gtja.com</a>

**(33) 中国银河证券股份有限公司**

注册地址:	北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
办公地址:	北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2—6 层
法定代表人:	陈有安
联系人:	邓颜
电话:	010-66568292
传真:	010-66568990
客户服务电话:	4008888888
网址:	<a href="http://www.chinastock.com.cn/">http://www.chinastock.com.cn/</a>

**(34) 申万宏源证券有限公司**

注册地址:	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层
办公地址:	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层
法定代表人:	李梅
联系人:	李玉婷
电话:	021-33389888
传真:	021-33388224
客户服务电话:	95523 或 4008895523
网址:	<a href="http://www.swhysc.com">www.swhysc.com</a>

**(35) 兴业证券股份有限公司**

注册地址:	福州市湖东路 99 号标力大厦
办公地址:	上海市浦东民生路 1199 弄五道口广场 1 号楼 21 层
法定代表人:	兰荣
联系人:	谢高得
电话:	021-38565785
传真:	021-38565783
客户服务电话:	4008888123/95562
网址:	<a href="http://www.xyzq.com.cn/">http://www.xyzq.com.cn/</a>

**(36) 长江证券股份有限公司**

注册地址:	武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
办公地址:	武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
法定代表人:	尤习贵
联系人:	奚博宇
电话:	027-65799999
传真:	027-85481900
客户服务电话:	95579;4008-888-999
网址:	<a href="http://www.95579.com/">http://www.95579.com/</a>

**(37) 安信证券股份有限公司**

注册地址:	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元
办公地址:	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元
法定代表人:	牛冠兴

联系人:	陈剑虹
电话:	0755-82825551
传真:	0755-82558355
客户服务电话:	95517, 4008001001
网址:	<a href="http://www.essences.com.cn">http://www.essences.com.cn</a>

**(38)渤海证券股份有限公司**

注册地址:	天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室
办公地址:	天津市南开区宾水西道 8 号
法定代表人:	王春峰
联系人:	胡天彤
电话:	022-28451861
传真:	022-28451892
客户服务电话:	4006515988
网址:	<a href="http://www.bhzq.com">http://www.bhzq.com</a>

**(39)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>

**(40)光大证券股份有限公司**

注册地址:	上海市静安区新闸路 1508 号
办公地址:	上海市静安区新闸路 1508 号
法定代表人:	薛峰
联系人:	刘晨
电话:	021-22169081
传真:	021-22169134
客户服务电话:	4008888788; 95525
网址:	<a href="http://www.ebscn.com/">http://www.ebscn.com/</a>

**(41)广州证券股份有限公司**

注册地址:	广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层
办公地址:	广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层
法定代表人:	邱三发
联系人:	林洁茹
电话:	020-88836999
传真:	020-88836654

客户服务电话:	95396
网址:	<a href="http://www.gzs.com.cn">http://www.gzs.com.cn</a>

**(42) 上海证券有限责任公司**

注册地址:	上海市西藏中路 336 号
办公地址:	上海市西藏中路 336 号
法定代表人:	龚德雄
联系人:	张瑾
电话:	021-53519888
传真:	021-63608830
客户服务电话:	4008918918、021-962518
网址:	<a href="http://www.962518.com">www.962518.com</a>

**(43) 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>

**(44) 国联证券股份有限公司**

注册地址:	无锡市县前东街 168 号
办公地址:	江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702 室
法定代表人:	范炎
联系人:	沈刚
电话:	0510-82831662
传真:	0510-82830162
客户服务电话:	4008885288（全国），0510-82588168（无锡）
网址:	<a href="http://www.glsc.com.cn">http://www.glsc.com.cn</a>

**(45) 平安证券股份有限公司**

注册地址:	广东省深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层
办公地址:	广东省深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层
法定代表人:	詹露阳
联系人:	郑舒丽
电话:	0755-22626172
传真:	0755-82400862
客户服务电话:	0755-22628888/95511
网址:	<a href="http://www.pingan.com/">http://www.pingan.com/</a>

**(46) 华安证券股份有限公司**

注册地址:	安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号
办公地址:	安徽省合肥市南二环 959 号财智中心 B1 座
法定代表人:	李工
联系人:	甘霖
电话:	0551—65161821
传真:	0551—65161672
客户服务电话:	0551—96518/4008096518
网址:	<a href="http://www.hazq.com/">http://www.hazq.com/</a>

**(47) 国都证券有限责任公司**

注册地址:	北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层
办公地址:	北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层
法定代表人:	常喆
联系人:	黄静
电话:	010—84183333
传真:	010—84183311—3389
客户服务电话:	400—818—8118
网址:	<a href="http://www.guodu.com">http://www.guodu.com</a>

**(48) 东海证券股份有限公司**

注册地址:	江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层
办公地址:	上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦
法定代表人:	朱科敏
联系人:	王一彦
电话:	021—20333333
传真:	021—50498825
客户服务电话:	95531; 4008888588
网址:	<a href="http://www.longone.com.cn">http://www.longone.com.cn</a>

**(49) 国盛证券有限责任公司**

注册地址:	江西省南昌市永叔路 15 号
办公地址:	江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦
法定代表人:	马跃进
联系人:	汪代强
电话:	0791—6285337
传真:	0791—6289395
客户服务电话:	4008222111
网址:	<a href="http://www.gsstock.com/">http://www.gsstock.com/</a>

**(50) 中泰证券股份有限公司**

注册地址:	山东省济南市经十路 20518 号
办公地址:	山东省济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人:	李玮
联系人:	吴阳
电话:	0531-81283938
传真:	0531-68889357
客户服务电话:	95538
网址:	<a href="http://www.zts.com.cn">www.zts.com.cn</a>

**(51) 华福证券有限责任公司**

注册地址:	福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层
办公地址:	福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层
法定代表人:	黄金琳
联系人:	张宗锐
电话:	0591-87383623
传真:	0591-87383610
客户服务电话:	96326 (福建省外请加拨 0591)
网址:	<a href="http://www.hfzq.com.cn">http://www.hfzq.com.cn</a>

**(52) 中国国际金融股份有限公司**

注册地址:	中国北京建国门外大街 1 号 国贸大厦 2 座 28 层
办公地址:	中国北京建国门外大街 1 号 国贸大厦 2 座 28 层
法定代表人:	李剑阁
联系人:	王雪筠
电话:	010-65051166
传真:	010-65051156
客户服务电话:	(010) 85679238/85679169; (0755) 83195000; (021) 63861195; 63861196
网址:	<a href="http://www.cicc.com.cn/">http://www.cicc.com.cn/</a>

**(53) 华鑫证券有限责任公司**

注册地址:	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元
办公地址:	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元
法定代表人:	洪家新
联系人:	陈敏
电话:	021-64316642
传真:	021-64333051
客户服务电话:	95323, 021-32109999, 029-68918888
网址:	<a href="http://www.cfsc.com.cn">http://www.cfsc.com.cn</a>

**(54) 中国中投证券有限责任公司**

注册地址:	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元
办公地址:	深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层
法定代表人:	龙增来
联系人:	刘毅

电话:	0755-82023442
传真:	0755-82026539
客户服务电话:	4006008008/95532
网址:	<a href="http://www.china-invs.cn/">http://www.china-invs.cn/</a>

**(55) 联讯证券股份有限公司**

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

**(56) 爱建证券有限责任公司**

注册地址:	上海市南京西路 758 号 23 楼
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼
法定代表人:	钱华
联系人:	戴莉丽
电话:	021-32229888
传真:	021-68728703
客户服务电话:	021-63340678
网址:	<a href="http://www.ajzq.com">http://www.ajzq.com</a>

**(57) 天风证券股份有限公司**

注册地址:	湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼
法定代表人:	余磊
联系人:	岑妹妹
电话:	027-87617017
客户服务电话:	400-800-5000/ 95391
网址:	<a href="http://www.tfzq.com/">http://www.tfzq.com/</a>

**(58) 首创证券有限责任公司**

注册地址:	北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座
办公地址:	北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座
法定代表人:	吴涛
客户服务电话:	400 620 0620
网址:	<a href="http://www.sczq.com.cn">www.sczq.com.cn</a>

**(59) 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:	沙常明
联系人:	丁倩云
电话:	010-56177851
传真:	0755-82075835
客户服务电话:	010-56177851
网址:	<a href="http://www.lczq.com/">http://www.lczq.com/</a>

**(60)泉州银行股份有限公司**

注册地址:	泉州市丰泽区云鹿路 3 号
办公地址:	泉州市丰泽区云鹿路 3 号
法定代表人:	傅子能
联系人:	董培姗
电话:	0595-22551071
传真:	0595-22505215
客户服务电话:	400-889-6312
网址:	<a href="http://www.qzccb.com">www.qzccb.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: (010) 59378888

传真: (010) 59378907

联系人: 朱立元

**三、出具法律意见书的律师事务所**

名称: 上海市通力律师事务所

注册地址: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人: 俞卫锋

电话: 021- 31358666

传真: 021- 31358600

联系人: 安冬

经办律师: 安冬、陆奇

**四、审计基金财产的会计师事务所**

名称: 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：林佳璐

经办注册会计师：张振波、林佳璐

#### 四、基金名称

博时睿益定增灵活配置混合型证券投资基金

#### 五、基金类型

混合型

#### 六、基金的投资目标

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

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

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

在封闭期，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-100%，其中定向增发（非公开发行）股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；转为上市开放式基金（LOF）后，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%，其中以事件驱动策略投资的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳

的交易保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%。

## 八 投资策略

### (一) 类别资产配置策略

本基金将按照风险收益配比原则，实行动态的资产配置。

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

### (二) 股票投资策略

#### (1) 定增参与策略

在本基金的封闭期，基金管理人将主要采取一级市场参与定向增发策略：

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

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

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

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

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

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

#### (2) 事件驱动策略

本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，主要采用事件驱动的投资策略。包括

### 1) 定增事件驱动策略

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

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

基金管理人对定向增发概念股票的筛选兼顾公司基本面分析以及定增项目前景及收益分析。就基本面分析而言，通过分析上市公司所处行业、主营业务、同行业竞争水平、公司内部管理水平、盈利能力、资本负债结构、商誉等，评估上市公司的“内在价值”。就定向增发项目而言，基金管理人将侧重于定增方案是否与公司现有业务具有协同效应，是否有助于提升公司核心竞争力和成长性，是否具有良好的业务增长空间等，并对定增项目的风险因素做充分的评估。从以上定增项目的选择标准出发，基金管理人拟（1）重点关注资产重组、资产收购类以及大股东参与的增发项目；（2）规避周期性行业在景气高位的扩产增发项目；（3）设定溢价率（二级市场交易价格相比与增发预案底价）以及“预案公告至股东大会公告”期间涨幅率量化指标；精选具有潜在定向增发效应提振的个股。

### 2) 股东增持与回购事件驱动

股份增持包括股东增持和高管增持，其中股东增持是指公司股东及其一致行动人增持股份行为；高管增持是指公司高管及其一致行动人增持股份的行为；股份回购是指公司按一定的程序购回发行或流通在外的本公司股份的行为。公司股权的变动不仅仅直接改变公司的资产结构，同时也会对企业未来在生产、经营、管理等多个方面产生影响。本基金通过定性和定量方法对股权变动可能带来的影响进行模拟分析，挑选具有绝对或相对估值吸引力的公司股票，再通过分析和评估股权变化，结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

### 3) 超预期业绩预告事件驱动

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

#### 4) 资产重组，包括重组、注入与并购事件

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

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

#### 5) 高分红及高转送事件

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

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

#### 6) 股权激励事件

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

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

#### 7) 其他影响公司的重大事件

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

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

### （三）股指期货投资策略

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

### （四）债券投资策略

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

### （五）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现

保值和锁定收益。

#### (六) 资产支持证券投资策略

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

#### (七) 中小企业私募债券投资策略

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

### 九 基金的业绩比较基准

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

### 十 风险收益特征

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

### 十一 基金的投资

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

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

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 12 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

#### 11.1 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	360,748,036.51	52.63
	其中：股票	360,748,036.51	52.63
2	固定收益投资	2,482,428.40	0.36
	其中：债券	2,482,428.40	0.36
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	286,000,000.00	41.73
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	35,730,080.19	5.21
7	其他各项资产	464,644.77	0.07
8	合计	685,425,189.87	100.00

## 11.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 11.2.1 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	16,459,561.17	2.41
C	制造业	203,621,053.80	29.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,089,273.02	6.74
E	建筑业	19,107,394.84	2.79
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	0.00
H	住宿和餐饮业	72,135,785.89	10.55
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,317,009.85	0.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	360,748,036.51	52.74

### 11.3 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	601877	正泰电器	3,811,149	92,934,868.05	13.59
2	600258	首旅酒店	2,809,573	72,135,785.89	10.55
3	600864	哈投股份	5,904,984	45,571,150.92	6.66
4	600267	海正药业	2,254,673	34,135,749.22	4.99
5	002568	百润股份	1,820,000	23,350,600.00	3.41
6	601969	海南矿业	1,972,386	16,459,561.17	2.41
7	600072	中船科技	1,286,834	15,133,169.11	2.21
8	000519	中兵红箭	1,647,164	15,112,729.70	2.21
9	002531	天顺风能	1,269,823	9,726,844.18	1.42
10	002503	搜于特	1,587,302	8,333,335.50	1.22

#### 11.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,482,428.40	0.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,482,428.40	0.36

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132013	17 宝武 EB	17,200	1,673,044.00	0.24
2	113013	国君转债	4,540	476,200.60	0.07
3	127004	模塑转债	3,570	332,117.10	0.05
4	110039	宝信转债	10	1,066.70	0.00

#### 11.6 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。

#### 11.7 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。

#### 11.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 11.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 11.10 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。

## 11.11 投资组合报告附注

**11.11.1** 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除海正药业（600267）外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

上海证券交易所于 2017 年 12 月 8 日发布公告称，浙江海正药业股份有限公司因业绩预告不准确、重大合同披露不及时、重大合同披露不完整等原因，被上海证券交易所处以公开谴责的纪律处分。

对该股票投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

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

### 11.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,005.38
2	应收证券清算款	166,763.84
3	应收股利	-
4	应收利息	283,875.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	464,644.77

### 11.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	127004	模塑转债	332,117.10	0.05

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 11.11.5 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	601877	正泰电器	47,067,677.80	6.88	定向增发
2	601877	正泰电器	45,867,190.25	6.71	定向增发
3	600258	首旅酒店	37,311,116.16	5.45	定向增发
4	600258	首旅酒店	34,824,669.73	5.09	定向增发
5	600864	哈投股份	26,892,364.44	3.93	定向增发
6	601969	海南矿业	8,481,259.80	1.24	定向增发
7	601969	海南矿业	7,978,301.37	1.17	定向增发
8	600072	中船科技	15,133,156.08	2.21	定向增发
9	000519	中兵红箭	7,824,029.00	1.14	定向增发

10	000519	中兵红箭	7,288,700.70	1.07	定向增发
11	002568	百润股份	11,274,900.00	1.65	定向增发
12	002531	天顺风能	9,726,844.18	1.42	定向增发
13	002503	搜于特	8,333,335.50	1.22	定向增发

### 11.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十二 基金的业绩

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

自基金合同生效开始，基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长 率①	净值增 长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2016.08.19-2016.12.31	0.30%	0.08%	-1.36%	0.36%	1.66%	-0.28%
2017.01.01-2017.12.31	-0.30%	0.59%	10.62%	0.32%	-10.92%	0.27%
2016.08.19-2017.12.31	0.00%	0.51%	9.12%	0.33%	-9.12%	0.18%

## 十三 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金上市费及年费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；

9、账户开户费用、账户维护费用；

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

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

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

$H$  为每日应计提的基金管理费

$E$  为前一日的基金资产净值

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

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

$H$  为每日应计提的基金托管费

$E$  为前一日的基金资产净值

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

上述“一、基金费用的种类中第 3—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于 2017 年 9 月 30 日刊登的本基金原招募说明书（《博时睿益事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）开放基金招募说明书》）进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要补充和更新的内容如下：

- 1、在“三、基金管理人”中，对基金管理人的基本情况进行了更新；
- 2、在“四、基金托管人”中，对基金托管人的基本情况进行了更新；
- 3、在“五、相关服务机构”中，更新了相关服务机构的内容，各新增代销机构均在指定媒体上公告列示；
- 4、在“九、基金的投资”中，更新了“（八）基金投资组合报告”的内容，数据内容截止时间为 2017 年 12 月 31 日；
- 5、在“十、基金的业绩”中，更新了基金业绩的内容，数据内容截止时间为 2017 年 12 月 31 日；
- 6、在“二十二、其它应披露的事项”中根据最新情况对相关应披露事项进行了更新：  

(一)、2018 年 02 月 14 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时睿益事件驱动混合基金（LOF）参加部分代销机构费率优惠活动的公告》；

(二)、2018 年 02 月 12 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时睿益定增灵活配置混合型证券投资基金转为上市开放式基金（LOF）及基金名称变更的公告》，《博时睿益事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回业务的公告》和《博时睿益事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）开放基金定期定额投资业务公告》；

(三)、2018 年 02 月 05 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时睿益定增灵活配置混合型证券投资基金转为上市开放式基金（LOF）及基金名称变更的提示性公告》；

(四)、2018 年 01 月 20 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时睿益定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告》

(五)、2017 年 10 月 27 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告

了《博时睿益定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告》；

(六)、2018 年 09 月 30 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时睿益定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书 2017 年第 2 号（摘要）》。

博时基金管理有限公司

2018 年 4 月 4 日