博时荣丰回报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：中国建设银行股份有限公司

【重要提示】

1、博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金由博时荣丰回报三年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满更名而来。本基金经中国证监会 2019 年 11 月 7 日证监许可【2019】2209 号文准予注册募集。

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、本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具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），在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下，如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下，可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击，发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

5、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。

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

7、本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的

股票”）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、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、债券回购、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款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）。

本基金基金资产可以投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）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。

本基金可投资资产支持证券（ABS）。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。

本基金可投资股指期货、国债期货。股指期货、国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价、指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。股指期货、国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

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。

8、基金合同生效后三年之内（含三年）为封闭期。在封闭期内，本基金不接受基金份额的申购和赎回，也不上市交易。

本基金封闭期届满转为开放式运作后，投资人方可在本基金的开放日办理基金份额的申购和赎回。

9、本基金的投资组合比例为：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 10%—100%，；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；封闭期届满转为开放式运作后，本基金的股票资产（含存托凭证）占基金资产的 10%-95%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约所需缴纳的交易保证金后，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%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

10、本基金发售面值为人民币 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。

11、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。

12、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。

本招募说明书（更新）所载内容截止日 2026 年 9 月 21 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2025 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

目录

【重要提示】 2
第一部分 绪言 6
第二部分 释义 7
第三部分 基金管理人 12
第四部分 基金托管人 21
第五部分 相关服务机构 24
第六部分 基金的募集与基金合同的生效 50
第七部分 基金份额的申购与赎回 51
第八部分 基金的投资 62
第九部分 基金的业绩 77
第十部分 基金的财产 78
第十一部分 基金资产的估值 79
第十二部分 基金的收益与分配 85
第十三部分 基金的费用与税收 87
第十四部分 基金的会计与审计 89
第十五部分 基金的信息披露 90
第十六部分 风险揭示 97
第十七部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算 104
第十八部分 基金合同的内容摘要 106
第十九部分 基金托管协议的内容摘要 121
第二十部分 对基金份额持有人的服务 140
第二十一部分 其他应披露的事项 143
第二十二部分 招募说明书存放及查阅方式 145
第二十三部分 备查文件 146

第一部分 绪言

《博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《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》”）和其他有关法律法规以及《博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的必要事项，投资人在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资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，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“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。基金投资者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。基金投资者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。

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：指博时荣丰回报三年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金或博时荣丰回报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：指中国建设银行股份有限公司

4、基金合同：指《博时荣丰回报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《博时荣丰回报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、招募说明书或本招募说明书：指《博时荣丰回报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《博时荣丰回报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（基金合同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）

8、基金份额发售公告：指《博时荣丰回报三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、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

10、《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

11、《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

12、《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

13、《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

14、《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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、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

17、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

18、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

19、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

20、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办法》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

21、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》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

22、投资人、投资者：指个人投资者、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

23、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

24、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

25、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

26、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

27、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为博时基金管理有限公司或接受博时基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

28、基金账户：指登记机构为投资人开立的、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

29、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

30、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

31、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

32、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

33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

34、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

35、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

36、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

37、封闭期：指自基金合同生效之日起至三年后的对应日（遇非工作日顺延至下一个工作日）的前一日的期间，如该日不存在对应日期的，则延后至下一个工作日。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易

38、开放日：指本基金进入开放期后，为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本基金参与港股通交易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）

39、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

40、《业务规则》：指《博时基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

41、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

42、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

43、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

44、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

45、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

46、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

47、巨额赎回：指本基金单个开放日，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)超过上一工作日基金总份额的 10%

48、元：指人民币元

49、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

50、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

51、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

52、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

53、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

54、基金份额分类：指本基金分设两类基金份额：A 类基金份额和 C 类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数

55、A 类基金份额：指在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

56、C 类基金份额：指在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

57、销售服务费：指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

58、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

59、摆动定价机制：指当本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

60、内地与香港股票市场交易互联互通机制：指上海证券交易所、深圳证券交易所分别和香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联合交易所”）建立技术连接，使内地和香港投资者可以通过当地证券公司或经纪商买卖规定范围内的对方交易所上市的股票。内地与香港股票市场交易互联互通机制包括沪港股票市场交易互联互通机制（以下简称“沪港通”）和深港股票市场交易互联互通机制（以下简称“深港通”）

61、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所和深圳证券交易所或经中国证监会认可的机构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的交易机制

62、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

63、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

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：张东

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：　杜松岭

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%；中国长城资产管理股份有限公司，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%；浙江省国际贸易集团有限公司，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

张东先生，硕士，董事长。1989 年至 2024 年先后在中国银行、招商银行从事零售金融、财富业务和财务会计等工作。2024 年加入博时基金管理有限公司，2024 年 5 月至 2025 年 10 月任公司总经理。自 2024 年 7 月 5 日起，任博时基金管理有限公司董事。2025 年 10 月 15 日至 2025 年 11 月 10 日代为履行博时基金管理有限公司总经理职务。自 2025 年 10 月 15 日起，任博时基金管理有限公司董事长。自 2026 年 2 月 12 日起代为履行博时基金管理有限公司首席信息官职责。

李德林先生，现任招商局金融控股有限公司副总经理。武汉大学金融学专业在职博士，高级经济师。曾任建银国际控股有限公司总裁助理，中德证券有限责任公司执行委员会委员，德意志银行董事总经理、中国区金融机构主管，招商银行总行办公室主任、战略客户部总经理兼机构客户部总经理，招商银行上海分行行长，招商银行行长助理、副行长等职务。

陈宇先生，总经理。曾任中国工商银行总行基金托管部客户经理/副主任科员（曾借调至中国证监会基金监管部三处任产品审核员），华夏银行总行基金托管部副处长、资产托管部处长，泰康资产管理有限责任公司营销总监、首席产品官、董事总经理、公司执行委员会成员，中邮人寿保险股份有限公司首席投资官。2017 年 7 月至 2025 年 9 月在招商局仁和人寿保险股份有限公司工作，历任首席投资官（兼资产管理中心总经理）、副总经理、首席运营官（COO）（集团二级公司总经理级）（期间 2019 年 5 月至 2025 年 5 月兼任招商局仁和养老投资有限公司 CEO）。2025 年加入博时基金管理有限公司，自 2025 年 11 月 11 日起，任公司总经理。

郝宇先生，硕士。1989 年 7 月至 1993 年 3 月在广东湛化企业集团公司工作，任财务部会计主任。1993 年 3 月至 1997 年 1 月在珠海深达实业投资有限公司工作，任财务部经理。1997 年 1 月至 2004 年 8 月在深圳招商房地产有限公司工作，历任职工董事、工会主席、财务副总监。2004 年 8 月至 2005 年 10 月在贵州省威宁彝族回族苗族自治县政府工作，任副县长。2005 年 10 月至 2011 年 12 月在深圳市招商创业有限公司工作，历任副总经理、财务总监。2012 年 1 月至 2016 年 7 月在招商局蛇口工业区控股股份有限公司工作，历任招标采购部总经理、产品管理中心副总经理。2016 年 7 月至 2018 年 2 月在招商局集团工作，任财务部部长助理。2018 年 2 月至 2025 年 11 月，在深圳市招商平安资产管理有限责任公司工作，历任党委委员、财务总监、纪委书记。2025 年 11 月至今，任招商局集团有限公司派出的专职外部董事。

郭智君先生，高级经济师。1993 年 7 月至 2000 年 2 月历任中国农业银行内蒙古分行会计、信贷员、人事教育处科员、副主任科员。2000 年 2 月至 2008 年 5 月历任中国长城资产管理公司呼和浩特办事处副处长、处长。2008 年 5 月至 2013 年 1 月历任中国长城资产管理公司人力资源部高级经理、总经理助理、副总经理。2013 年 1 月至 2022 年 2 月历任中国长城资产管理股份有限公司内蒙古分公司党委副书记、副总经理（主持工作）、总经理、党委书记。2022 年 2 月至今历任中国长城资产管理股份有限公司资产经营六部总经理级干部、总经理。

方瓯华先生，复旦大学硕士，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、上海盛业股权投资基金公司执行董事（法人代表）、上海永泰房地产开发公司总经理等职，负责公司整体运营。2018 年，出任博时基金管理公司第七届董事会董事，2021 年卸任。自 2022 年 8 月起，任博时基金管理有限公司董事。

邹月娴女士，香港大学博士，新加坡归国学者。现任北京大学教授/博士生导师，北京大学深圳研究生院党委副书记，鹏城实验室兼职教授，中国计算机学会语音对话与听觉专委会委员，中国自动化学会模式识别与机器智能专业委员会委员，深圳市人工智能学会常务副理事长兼秘书长；荣获深圳市地方级高层次专业人才、深圳市三八红旗手等称号；曾获中国电子工业部科技进步三等奖，深圳市科学技术奖技术开发一等奖；在国际顶级期刊和旗舰会议发表高水平论文 300 多篇，入选全球前 2%顶尖科学家榜单。

陆海天先生，法学博士。现任香港理工大学内地发展处总监、可持续技术基金会会计及金融学教授。历任香港理工大学商学院副院长、会计及金融学院副院长、纽约大学斯特恩商学院客座研究教授。香港理工大学终身教授。

张博辉先生，2008 年 8 月参加工作，新加坡南洋理工大学金融学专业毕业，博士研究生学历，博士学位。2008 年至 2018 年在澳大利亚新南威尔士大学工作，历任金融系讲师、副教授、国际金融中心副主任、教授。2017 年至今在香港中文大学（深圳）工作，历任深圳高等金融研究院副院长、经管学院执行副院长，现任经管学院执行院长、校长讲座教授、深圳数据经济研究院副院长、深圳高等金融研究院金融科技与社会金融研究中心主任。

方芳女士，上海财经大学国民经济学专业博士、加拿大不列颠哥伦比亚大学访问学者。1985 年 7 月至今，就职于上海财经大学。历任上海财经大学公共经济与管理学院副院长 、上海财经大学公共经济与管理学院党委书记。2023 年 2 月至今，任上海财经大学财税投资学院投资发展研究院院长、金融硕士（首席投资官）教育项目中心主任。同时，任世界华人不动产学会副秘书长、中国基本建设优化研究会理事、上海市投资学会会员等社会职务。

贺春临女士，现任博时基金管理有限公司工会主席，中共党员。先后在武汉大学获法学学士学位、法学硕士学位及经济学博士学位。2003 年 6 月至 2013 年 10 月在招商银行总行

工作，历任银行业务研究员、企业文化中心经理、办公室高级经理、品牌管理室主管。2013年10月至今在博时基金管理有限公司工作，历任总裁办公室副总经理、战略发展中心总经理、董事会办公室副总经理、董事会办公室总经理兼党委宣传部部长、战略发展部首席战略官兼党委宣传部部长、党委宣传部部长、工会主席等。

2、高级管理人员

张东先生，简历同上。

陈宇先生，简历同上。

吴慧峰先生，硕士，副总经理、财务负责人、董事会秘书。1996年至2023年先后在中国南山开发集团股份有限公司、上海诚南房地产开发有限公司、招商局金融集团有限公司、招商证券股份有限公司从事财务、公司管理等工作。2023年加入博时基金管理有限公司，现任公司副总经理、财务负责人、董事会秘书，兼任博时资本管理有限公司董事长和博时财富基金销售有限公司董事。

吴曼女士，硕士，督察长。2003年至2024年先后在中国证券监督管理委员会深圳监管局历任副主任科员、主任科员、副处长等职务，北京市君合（深圳）律师事务所任合伙人，招商证券股份有限公司任法律合规部总经理，其中2021年1月至2022年6月兼任招商证券资产管理有限公司合规总监。2024年加入博时基金管理有限公司，现任公司督察长。

3、本基金基金经理

陈伟先生，硕士。2013年从清华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、研究员兼基金经理助理、高级研究员兼基金经理助理、资深研究员兼基金经理助理、资深研究员兼投资经理、博时恒康一年持有期混合型证券投资基金(2020年12月30日-2023年2月8日)、博时弘泰定期开放混合型证券投资基金(2021年4月13日-2023年4月19日)、博时恒盛一年持有期混合型证券投资基金(2021年4月13日-2023年6月21日)、博时恒旭一年持有期混合型证券投资基金(2021年7月21日-2024年10月28日)、博时稳益9个月持有期混合型证券投资基金(2021年11月9日-2025年2月6日)的基金经理。现任博时睿远事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）(2019年10月30日—至今)、博时惠泽混合型发起式证券投资基金(2023年12月4日—至今)、博时移动互联主题混合型证券投资基金(2025年11月20日—至今)、博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金(2025年11月21日—至今)、博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金(2026年4月14

日—至今)、博时科创板三年定期开放混合型证券投资基金(2026 年 7 月 16 日—至今)的基金经理。

4、投资决策委员会成员

公司首席资产配置官黄健斌先生。

公司投资决策委员会专职委员兼年金投资部总经理于善辉先生。

首席基金经理过钧先生。

首席投资官兼权益投研一体化总监、境外投资部总经理曾鹏先生。

董事总经理兼权益投资三部总经理、权益投资三部投资总监蔡滨先生。

行业研究部总经理魏立先生。

宏观策略部首席策略分析师陈显顺先生。

指数与量化投资部总经理兼指数与量化投资部投资总监赵云阳先生。

5、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、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，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、中期和年度基金报告；

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》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

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者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《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条件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。

四、基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

（1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）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。

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

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

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

五、基金经理承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益；

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。

六、基金管理人的内部控制制度

1、风险管理的原则

（1）全面性原则

公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节。

（2）独立性原则

公司设立独立的法律合规部，法律合规部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行监督和检查。

（3）相互制约原则

公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

（4）定性和定量相结合原则

建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对风险管理负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，法律合规部负责监督和检查公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会

负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任。

（2）风险管理委员会

作为董事会下的专业委员会之一，风险管理委员会负责批准公司风险管理系统文件，即负责确保每一个部门都有合适的系统来识别、评定和监控该部门的风险，负责批准每一个部门的风险级别。负责解决重大的突发的风险。

（3）督察长

独立行使督察权利；直接对董事会负责；按季向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议。

（4）法律合规部

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

（5）风险管理部

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

（6）业务部门

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

3、风险管理和内部风险控制的措施

（1）建立内控结构，完善内控制度

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

（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制

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

（3）建立、健全岗位责任制

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

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序

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

（5）建立有效的内部监控系统

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

（6）使用数量化的风险管理手段

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

（7）提供足够的培训

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

第四部分　基金托管人

一、基金托管人情况

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：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：张金良

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：王小飞

联系电话：(021)6063　7103

（二）主要人员情况

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金业务处、证券保险业务处、理财信托业务处、全球业务处、养老金业务处、新兴业务处、客户服务与业务协同处、运营管理处、跨境与外包管理处、托管应用系统支持处、内控合规处等 12 个职能处室，在北京、上海、合肥设有托管运营中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2024 年末，中国建设银行已托管 1405 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，

赢得了业内的高度认同。中国建设银行多次被《全球托管人》、 《财资》、《环球金融》杂志及《中国基金报》评选为“最佳托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司（中债）“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司（上清所）“优秀托管银行”奖项、并先后荣获《亚洲银行家》颁发的 2017 年度“最佳托管系统实施奖”、2019 年度“中国年度托管业务科技实施奖”、2021 年度“中国最佳数字化资产托管银行”、以及 2020 及 2022 年度“中国年度托管银行（大型银行）”奖项。2022 年度，荣获《环球金融》 “中国最佳次托管银行”，并作为唯一中资银行获得《财资》“中国最佳 QFI 托管银行”奖项。2023 年度，荣获中国基金报“公募基金 25 年最佳基金托管银行”奖项。2024 年度，荣获《中国基金报》“优秀 ETF 托管人”、《中国证券报》“ETF 金牛生态圈卓越托管机构（银行）”、《环球金融》“中国最佳次托管人”等奖项。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格检查，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

（二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制的有效性进行指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

（三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

（一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

（二）监督流程

1.每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

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

地址：北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301

电话：010-65187055

传真：010-65187032

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：	葛海蛟
联系人：	高越
电话：	010-66594973
客户服务电话：	95566
网址：	http://www.boc.cn/

(2)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：	张金良
联系人：	张静
传真：	010－66275654
客户服务电话：	95533
网址：	http://www.ccb.com/

(3)交通银行股份有限公司

注册地址：	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址：	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
法定代表人：	任德奇
联系人：	高天
电话：	021-58781234
传真：	021-58408483
客户服务电话：	95559
网址：	http://www.bankcomm.com/

(4)招商银行股份有限公司

注册地址：	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址：	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦
法定代表人：	缪建民
联系人：	季平伟
电话：	0755－83198888
传真：	0755－83195049
客户服务电话：	95555
网址：	http://www.cmbchina.com/

(5)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：	朱鹤新
联系人：	王晓琳
电话：	010－89937325
客户服务电话：	95558
网址：	http://bank.ecitic.com/

(6)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：	郑杨
联系人：	吴斌
电话：	021－61618888
传真：	021－63602431
客户服务电话：	95528
网址：	http://www.spdb.com.cn

(7)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
传真：	010－68858117
客户服务电话：	95580
网址：	http://www.psbc.com

(8)广发银行股份有限公司

注册地址：	广州市越秀区东风东路 713 号
办公地址：	广州市越秀区东风东路 713 号
法定代表人：	王凯
联系人：	刘伟
电话：	020-38321497/020-38322566
传真：	020-38321676

客户服务电话：	4008308003
网址：	http://www.cgbchina.com.cn/

(9)平安银行股份有限公司

注册地址：	深圳市深南东路 5047 号
办公地址：	深圳市深南东路 5047 号
法定代表人：	谢永林
联系人：	施艺帆
电话：	021-50979384
传真：	021-50979507
客户服务电话：	95511-3
网址：	http://bank.pingan.com

(10)宁波银行股份有限公司

注册地址：	宁波市鄞州区宁南南路 700 号
办公地址：	宁波市鄞州区宁南南路 700 号
法定代表人：	陆华裕
联系人：	胡技勋
电话：	0574-89068340
传真：	0574-87050024
客户服务电话：	95574
网址：	http://www.nbcb.com.cn

(11)北京农村商业银行股份有限公司

注册地址：	北京市西城区月坛南街 1 号院 2 号楼
办公地址：	北京市西城区月坛南街 1 号院 2 号楼
法定代表人：	王金山
联系人：	鲁娟
电话：	010-89198762
传真：	010-89198678
客户服务电话：	96198
网址：	http://www.bjrcb.com

(12)浙商银行股份有限公司

注册地址：	浙江省杭州市庆春路 288 号
办公地址：	浙江省杭州市庆春路 288 号
法定代表人：	张达洋
联系人：	毛真海
电话：	0571-87659546
传真：	0571-87659188
客户服务电话：	95527
网址：	http://www.czbank.com

(13)南京银行股份有限公司

注册地址：	南京市白下区淮海路 50 号

办公地址：	南京市玄武区中山路 288 号
法定代表人：	林复
联系人：	刘晔
电话：	025－86775335
传真：	025－86775376
客户服务电话：	95302
网址：	http://www.njcb.com.cn

(14)江苏银行股份有限公司

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

(15)渤海银行股份有限公司

注册地址：	天津市河东区海河东路 218 号
办公地址：	天津市河东区海河东路 218 号
法定代表人：	李伏安
联系人：	王宏
电话：	022-58316666
传真：	022-58316569
客户服务电话：	95541
网址：	http://www.cbhb.com.cn

(16)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 1512 室
法定代表人：	江建法
联系人：	沈斯诺
客户服务电话：	95343
网址：	www.mintaibank.com

(17)东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：	广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号
办公地址：	广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦
法定代表人：	王耀球
联系人：	杨亢
电话：	0769-22866270
传真：	0769-22866282
客户服务电话：	961122

网址：	http://www.drcbank.com/

(18)嘉兴银行股份有限公司

注册地址：	嘉兴市昌盛南路 1001 号
办公地址：	嘉兴市昌盛南路 1001 号
法定代表人：	林斌
联系人：	顾晓光
电话：	0573-82099660
传真：	0573-82099660
客户服务电话：	0573-96528
网址：	http://www.jxccb.com/

(19)江苏苏州农村商业银行股份有限公司

注册地址：	江苏省苏州市吴江区中山南路 1777 号
办公地址：	江苏省苏州市吴江区中山南路 1777 号
法定代表人：	徐晓军
联系人：	葛晓亮
电话：	0512-63969209
传真：	0512-63969209
客户服务电话：	956111
网址：	www.szrcb.com

(20)苏州银行股份有限公司

注册地址：	江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号
办公地址：	江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号
法定代表人：	崔庆军
联系人：	吴骏
电话：	0512-69868373
传真：	0512-69868370
客户服务电话：	96067
网址：	www.suzhoubank.com

(21)珠海华润银行股份有限公司

注册地址：	广东省珠海市吉大九洲大道东 1346 号
办公地址：	广东省珠海市吉大九洲大道东 1346 号
法定代表人：	刘晓勇
联系人：	李阳
电话：	96588（广东省外加拨 0756）
传真：	0755-82811423
客户服务电话：	96588（广东省外加拨 0756）
网址：	http://www.crbank.com.cn/

(22)晋商银行股份有限公司

注册地址：	山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦
办公地址：	山西省太原市万柏林区长风西街一号丽华大厦

法定代表人：	阎俊生
联系人：	董嘉文
电话：	0351-6819926
传真：	0351-6819926
客户服务电话：	95105588
网址：	http://www.jshbank.com

(23)浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司

注册地址：	浙江绍兴柯桥笛扬路 1363 号
办公地址：	浙江绍兴柯桥笛扬路 1363 号
法定代表人：	俞俊海
联系人：	孟建潮
电话：	0575-84788101
传真：	0575-84788134
客户服务电话：	400-889-6596
网址：	http://www.borf.cn

(24)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：	深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路 136 号深圳新一代产业园 2 栋 3703-A
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：	张斌
联系人：	张燕
电话：	010-58325388
传真：	010-58325300
客户服务电话：	4000661199-2
网址：	www.xinlande.com.cn

(25)厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：	厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场 1501-1504
办公地址：	厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场 1501-1504
法定代表人：	陈洪生
联系人：	徐明静
电话：	0592-3122716
传真：	0592-8060771
客户服务电话：	400-918-0808
网址：	www.xds.com.cn

(26)江苏天鼎证券投资咨询有限公司

注册地址：	南京市秦淮区太平南路 389 号 1002 室
办公地址：	南京市鼓楼区平安里 74 号
法定代表人：	金婷婷
联系人：	黄丹昀
电话：	025-66001159

传真：	025-66001172
客户服务电话：	025-962155
网址：	www.tdtz888.com

(27)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)；4000890555
网址：	https://www.txfund.com/

(28)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：	www.duxiaomanfund.com

(29)博时财富基金销售有限公司

注册地址：	广东省深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层
办公地址：	广东省深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层
法定代表人：	王德英
联系人：	崔丹
电话：	0755-83169999
传真：	0755-83195220
客户服务电话：	400-610-5568
网址：	www.boserawealth.com

(30)诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：	上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 6 层
办公地址：	上海市闵行区申滨南路 1226 号诺亚财富中心
法定代表人：	吴卫国
联系人：	黄欣文
电话：	021-38602377
传真：	021-38509777
客户服务电话：	400-821-5399

网址：	http://www.noah-fund.com

(31)深圳众禄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：	https://www.zlfund.cn/

(32)上海天天基金销售有限公司

注册地址：	上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
办公地址：	上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼
法定代表人：	其实
联系人：	潘世友
电话：	021-54509998
传真：	021-64385308
客户服务电话：	400-181-8188
网址：	http://www.1234567.com.cn

(33)蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：	浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室
办公地址：	浙江省杭州市西湖区西溪路 556 号
法定代表人：	王珺
联系人：	韩爱彬
电话：	021-60897840
传真：	0571-26697013
客户服务电话：	95188-8
网址：	http://www.fund123.cn

(34)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：	http://www.erichfund.com

(35)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：	952555
网址：	www.5ifund.com

(36)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：	http://a.leadfund.com.cn/

(37)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：	www.harvestwm.cn

(38)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：	http://www.yixinfund.com

(39)华源证券股份有限公司（鑫理财）

注册地址：	青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号
办公地址：	湖北省武汉市江汉区万松街道青年路 278 号中海中心 32F-34F

法定代表人：	邓晖
联系人：	丛瑞丰
电话：	15069421014
传真：	-
客户服务电话：	95305
网址：	www.huayuanstock.com

(40)北京汇成基金销售有限公司

注册地址：	北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2
办公地址：	北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2
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：	010-63158805
网址：	www.hcfunds.com

(41)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 401 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：	孙亚超
联系人：	刘晖
电话：	021-60206991
传真：	021-80133413
客户服务电话：	400-808-1016
网址：	www.fundhaiyin.com

(42)上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：	中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元
办公地址：	上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元
法定代表人：	张俊
联系人：	张蜓
电话：	021-20219988-35374
传真：	021-20219923
客户服务电话：	021-20292031
网址：	wg.com.cn

(43)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：	www.520fund.com.cn

(44)上海基煜基金销售有限公司

注册地址：	上海市黄浦区广东路 500 号 30 层 3001 单元
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

(45)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

(46)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：	020-89629066
网址：	www.yingmi.cn

(47)和耕传承基金销售有限公司

注册地址：	河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503
办公地址：	河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503
法定代表人：	温丽燕
联系人：	董亚芳
电话：	0371-85518396
传真：	0371-85518397

客户服务电话：	400-0555-671
网址：	www.hgccpb.com

(48)中证金牛（北京）基金销售有限公司

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 4 层、5 层　　（邮寄填写 4 层）
法定代表人：	吴志坚
联系人：	焦金岩
电话：	010-63156530
传真：	010-63156532
客户服务电话：	400-890-9998
网址：	www.jnlc.com

(49)京东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/

(50)北京雪球基金销售有限公司

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：	李楠
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

(51)上海中欧财富基金销售有限公司

注册地址：	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号 502 室
办公地址：	上海市虹口区公平路 18 号 8 栋嘉昱大厦 6 层
法定代表人：	许欣
联系人：	刘弘义
电话：	15608193006
传真：	+86　21　35073616

客户服务电话：	021-68609700
网址：	https://www.zocaifu.com/

(52)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
联系人：	张静怡
电话：	010-88066326
客户服务电话：	400-817-5666
网址：	https://www.amcfortune.com/

(53)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：	梁美娜
电话：	021-80365243
传真：	021-60819988
客户服务电话：	400-990-8826
网址：	www.citicsf.com

(54)国泰海通证券股份有限公司

注册地址：	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号
办公地址：	上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦
法定代表人：	朱健
联系人：	钟伟镇
电话：	021-38676666
传真：	021-38670666
客户服务电话：	95521/4008888666
网址：	https://www.gtht.com

(55)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：	北京市朝阳区光华路 10 号
法定代表人：	刘成
联系人：	陈海静
电话：	010-65608231
传真：	010－65182261
客户服务电话：	4008888108/95587
网址：	http://www.csc108.com/

(56)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：	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 37 楼
法定代表人：	张纳沙
联系人：	于智勇
电话：	0755-81981259
传真：	0755-82133952
客户服务电话：	95536
网址：	http://www.guosen.com.cn/

(57)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：	业清扬
电话：	0755-83081954
传真：	0755-83734343
客户服务电话：	95565
网址：	http://www.cmschina.com/

(58)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：	杜杰
电话：	010-60833889
传真：	010－84865560
客户服务电话：	95548
网址：	http://www.cs.ecitic.com/

(59)中国银河证券股份有限公司

注册地址：	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101
办公地址：	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦
法定代表人：	王晟
电话：	010-80928123
客户服务电话：	4008-888-888 或 95551
网址：	http:// www.chinastock.com.cn/

(60)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：	http://www.htsec.com/

(61)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 号世纪商贸广场 45 层
法定代表人：	张剑
电话：	021-33388999
传真：	021-33388224
客户服务电话：	95523
网址：	www.swhysc.com

(62)兴业证券股份有限公司

注册地址：	福州市湖东路 268 号
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：	杨华辉
电话：	021-38565547
传真：	021－38565783
客户服务电话：	95562
网址：	http://www.xyzq.com.cn/

(63)长江证券股份有限公司

注册地址：	湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号
办公地址：	湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号
法定代表人：	刘正斌
联系人：	奚博宇
电话：	027-65799999
传真：	027-85481900
客户服务电话：	95579
网址：	http://www.95579.com/

(64)国投证券股份有限公司

注册地址：	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦
办公地址：	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦
法定代表人：	王苏望
电话：	0755-82558266
客户服务电话：	95517
网址：	http://www.sdicsc.com.cn

(65)西南证券股份有限公司

注册地址：	重庆市江北区金沙门路 32 号
办公地址：	重庆市江北区金沙门路 32 号
法定代表人：	杨雨松

联系人：	宋涧乔
电话：	023-67747414
传真：	023-63786212
客户服务电话：	4008096096
网址：	http://www.swsc.com.cn

(66)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：	林俊波
联系人：	孙越
电话：	021-38784580-8920
客户服务电话：	95351
网址：	http://www.xcsc.com

(67)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 18、19 楼全层
办公地址：	广东省广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 座 12 层
法定代表人：	王达
联系人：	丁思
电话：	020-83988334
客户服务电话：	95322
网址：	http://www.wlzq.cn

(68)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：	天津市南开区宾水西道 8 号
法定代表人：	安志勇
联系人：	王星
电话：	022-23861692
传真：	022－28451892
客户服务电话：	956066
网址：	https://www.bhzq.com

(69)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 1 号楼 2001
办公地址：	青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层
法定代表人：	肖海峰
联系人：	赵如意
电话：	0532-85725062
客户服务电话：	95548

网址：	sd.citics.com

(70)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：	95330
网址：	https://www.dwzq.com.cn

(71)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：	祝瑞敏
联系人：	王薇安
电话：	010－83252170
传真：	010－63081344
客户服务电话：	95321
网址：	http://www.cindasc.com

(72)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：	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：	http://www.ebscn.com/

(73)中信证券华南股份有限公司

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：	陈可可
联系人：	郭杏燕
电话：	020-88836999
传真：	020-88836984
客户服务电话：	95548
网址：	http://www.gzs.com.cn

(74)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：	http://www.nesc.cn

(75)南京证券股份有限公司

注册地址：	江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号
办公地址：	江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号
法定代表人：	李剑锋
联系人：	潘月
电话：	025－52310569
传真：	025－52310586
客户服务电话：	4008285888
网址：	http://www.njzq.com.cn

(76)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：	魏熠珲
电话：	021-53686278
传真：	021-53686835
客户服务电话：	4008918918
网址：	https://www.shzq.com/

(77)诚通证券股份有限公司

注册地址：	北京市朝阳区东三环北路 27 号楼 12 层
办公地址：	北京市朝阳区东三环北路 27 号楼 12 层
法定代表人：	张威
电话：	010-83561146
客户服务电话：	95399
网址：	www.cctgsc.com.cn

(78)大同证券有限责任公司

注册地址：	山西省大同市平城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层
办公地址：	山西省太原市小店区长治路 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：	0351-7219891
客户服务电话：	4007121212
网址：	www.dtsbc.com.cn

(79)国联民生证券股份有限公司

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：	顾伟
客户服务电话：	95570
网址：	http://www.glsc.com.cn

(80)平安证券股份有限公司

注册地址：	深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层
办公地址：	深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 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：	http:www.stock.pingan.com

(81)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：	孙懿
电话：	0551-65161821
传真：	0551－65161672
客户服务电话：	95318
网址：	http://www.hazq.com/

(82)财信证券股份有限公司

注册地址：	长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼
办公地址：	长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼
法定代表人：	蔡一兵
联系人：	郭磊
电话：	0731-84403319
传真：	0731-84403439
客户服务电话：	0731-84403360
网址：	http://www.cfzq.com/

(83)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：	http://www.guodu.com

(84)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：	http://www.longone.com.cn

(85)恒泰证券股份有限公司

注册地址：	内蒙古呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼
法定代表人：	祝艳辉
联系人：	熊丽
电话：	0471－4972675
客户服务电话：	956088
网址：	http://www.cnht.com.cn/

(86)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：	刘朝东
联系人：	占文驰
电话：	0791－86283372
传真：	0791－6289395
客户服务电话：	956080
网址：	https://www.gszq.com/

(87)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：	赵静静

电话：	010-58124967
传真：	028-86150040
客户服务电话：	95584
网址：	https://www.hx168.com.cn/

(88)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：	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
法定代表人：	王献军
联系人：	梁丽
电话：	0991-2307105
传真：	010-88085195
客户服务电话：	95523 或 4008895523
网址：	www.swhysc.com

(89)中泰证券股份有限公司

注册地址：	济南市市中区经七路 86 号
办公地址：	山东省济南市市中区经七路 86 号证券大厦 2309
法定代表人：	王洪
联系人：	张峰源
电话：	021-20315719
客户服务电话：	95538
网址：	www.zts.com.cn

(90)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：	广东省深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦北塔 23-25 楼
法定代表人：	李强
联系人：	徐玲娟
电话：	0755-83199599-9135
传真：	0755－83199545
客户服务电话：	4008323000
网址：	http://www.csco.com.cn/

(91)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：	青美平措
联系人：	单晶
电话：	0755-23838750

传真：	0755-25838701
客户服务电话：	95358
网址：	http://www.firstcapital.com.cn/

(92)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：	祁建邦
电话：	0931-4890208
传真：	0931-4890628
客户服务电话：	95368
网址：	https://www.hlzq.com/

(93)五矿证券有限公司

注册地址：	深圳市南山区粤海街道海珠社区滨海大道 3165 号五矿金融大厦 2401
办公地址：	深圳市南山区滨海大道与后海滨路交汇处滨海大道 3165 号五矿金融大厦（18-25 层）
法定代表人：	黄海洲
联系人：	赵晓棋
电话：	0755-23375447
客户服务电话：	4001840028
网址：	http://www.wkzq.com.cn

(94)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：	上海市黄浦区福州路 666 号 6 楼
法定代表人：	俞洋
联系人：	刘熠
电话：	021-54967656
传真：	021-64333051
客户服务电话：	95323,021-32109999,029-68918888
网址：	http://www.cfsc.com.cn

(95)中国中金财富证券有限公司

注册地址：	深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-4608
办公地址：	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 18-21 层及第 04 层
法定代表人：	高涛
联系人：	万玉琳
电话：	0755-82026907
传真：	0755-82026539

客户服务电话：	4006008008/95532
网址：	http://www.china-invs.cn/

(96)东方财富证券股份有限公司

注册地址：	西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼
办公地址：	上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦
法定代表人：	戴彦
联系人：	付佳
电话：	021-23586603
传真：	021-23586860
客户服务电话：	95357
网址：	http://www.18.cn

(97)粤开证券股份有限公司

注册地址：	广州市黄埔区科学大道 60 号开发区控股中心 19、21、22、23 层
办公地址：	广州市黄埔区科学大道 60 号开发区控股中心 19、21、22、23 层
法定代表人：	郭川舟
联系人：	彭莲
电话：	0755-83331195
客户服务电话：	95564
网址：	http://www.ykzq.com

(98)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：	http://www.gjzq.com.cn

(99)华宝证券股份有限公司

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：	刘加海
联系人：	刘闻川
电话：	021-68777222
传真：	021－68777822
客户服务电话：	4008209898;021-38929908
网址：	http://www.cnhbstock.com

(100)长城国瑞证券有限公司

注册地址：	厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼
办公地址：	厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼
法定代表人：	李鹏
联系人：	布前
电话：	010-68080680
传真：	0592-2079228
客户服务电话：	0592-5163588
网址：	http://www.xmzq.cn

(101)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：	http://www.ajzq.com

(102)国新证券股份有限公司

注册地址：	北京市西城区车公庄大街 4 号 2 幢 1 层 A2112 室
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：	http://www.crsec.com.cn

(103)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：	http://www.kysec.cn/

(104)玄元保险代理有限公司

注册地址：	中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室
办公地址：	中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室
法定代表人：	马永谙

联系人：	卢亚博
电话：	021-50701053
传真：	021-50701053
客户服务电话：	4000808208
网址：	www.licaimofang.com

(105)阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：	海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层
办公地址：	北京市朝阳区朝外大街 20 号联合大厦 701A 室
法定代表人：	李科
联系人：	王超
电话：	010-59053660
传真：	010-85632773
客户服务电话：	95510
网址：	http://fund.sinosig.com/

(106)湖南银行股份有限公司

注册地址：	湖南省长沙市天心区湘江中路二段 210 号
办公地址：	湖南省长沙市天心区湘江中路二段 210 号
法定代表人：	黄卫忠
联系人：	张鹏君
电话：	0731-96599
传真：	0731-89828806
客户服务电话：	0731-96599
网址：	www.hunan-bank.com

(107)深圳前海微众银行股份有限公司

注册地址：	广东省深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室
办公地址：	深圳市南山区沙河西路 1819 号深圳湾科技生态园 7 栋 A 座
法定代表人：	顾敏
联系人：	白冰
电话：	89959999-3306
客户服务电话：	95384
网址：	http://www.webank.com/

(108)云南红塔银行股份有限公司

注册地址：	云南省玉溪市东风南路 2 号
办公地址：	云南省昆明市盘龙区世博路低碳中心 A 座
法定代表人：	李光林
联系人：	马杰
电话：	0871-65236624
传真：	0871-65236614

客户服务电话：	0877-96522
网址：	www.ynhtbank.com

二、登记机构

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：北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301

法定代表人：张东

电话： 010-65171166

传真： 010-65187068

联系人：侣方方

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：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所： 北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：（010）58153000

传真电话：（010）85188298

经办注册会计师：楼坚、王海彦、朱燕

联系人：朱燕

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 11 月 7 日证监许可【2019】2209 号文准予募集注册。

本基金募集期自 2020 年 4 月 20 日至 2020 年 4 月 30 日期间，基金份额共募集 313136375.35 份（含利息结转的份额），募集有效认购总户数为 5253 户。

本基金的运作方式为契约型开放式，存续期间为不定期。本基金基金合同生效后，前三年封闭运作。本基金封闭期自基金合同生效之日起至三年后的对应日（遇非工作日顺延至下一个工作日）的前一日的期间，如该日不存在对应日期的，则延后至下一个工作日。在封闭期内，本基金不接受基金份额的申购和赎回。

封闭期届满后，本基金转为开放式运作，基金名称变更为“博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金”。除此之外，本基金的基金费率，基金的投资范围等均不变。

二、基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2023 年 5 月 9 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，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在十个工作日向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在六个月内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　基金份额的申购与赎回

一、申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或基金管理人网站列明。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。基金投资者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。

二、申购与赎回办理的开放日及时间

1、封闭期、开放日及开放时间

基金合同生效后三年之内（含三年）为封闭期。在封闭期内，本基金不接受基金份额的申购和赎回，也不上市交易。

本基金封闭期届满转为开放式运作后，投资人方可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、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间（若本基金参与港股通交易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。

基金合同生效后，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

基金管理人自基金封闭期届满并转为开放式运作之日起不超过 30 天开始办理申购和赎回，在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

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。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类别基金份额申购、赎回的价格。

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、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、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则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

四、申购与赎回的数额限制

1、投资人首次申购本基金A类基金份额或C类基金份额的最低金额为10元（含申购费），追加申购最低金额为10元（含申购费）；详情请见当地销售机构公告；

2、每个交易账户最低持有基金份额余额为10份，若某笔赎回导致单个交易账户的某一类别基金份额余额少于10份时，该类份额余额部分基金份额必须一同赎回；

3、投资人通过销售机构赎回基金份额时，本基金单笔某一类份额赎回申请不得低于10份，若投资者单个交易账户持有的某类基金份额余额不足10份，将不受此限制，但投资者在提交赎回申请时须将该类份额全部赎回。各销售机构在符合上述规定的前提下，可根据自己的情况调整单笔赎回申请限制，具体以销售机构公布的为准，投资人需遵循销售机构的相关规定。

4、本基金目前对单个投资人累计持有份额不设上限限制，但法律法规或监管机构另有规定或基金合同另有约定的除外。将来，基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额数量限制，具体规定见更新的招募说明书或相关公告；

5、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。具体请参见招募说明书或相关公告；

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前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

五、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，投资人全额交付申购款项，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。在发生巨额赎回或基金合同约定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。

遇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业务处理流程，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，则申购款项本金退还给投资人。

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的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

六、申购费率、赎回费率

1、投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金 A 类基金份额收取申购费用，C 类基金份额不收取申购费用。投资者的申购费用如下：

表 2：本基金的申购费率

金额（M）	A 类基金份额申购费率	C 类基金份额申购费率
M＜50 万元	1.20%	0%

50 万元≤M＜100 万元	0.80%	
100 万元≤M＜500 万元	0.60%	
M≥500 万元	1000 元/笔	

本基金的申购费用由投资人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用，不列入基金财产。

2、赎回费

赎回费率见下表：

持有期（Y）	A 类赎回费率	C 类赎回费率
Y＜7 日	1.50%	1.50%
7 日≤Y＜30 日	0.75%	0.50%
30 日≤Y＜6 个月	0.50%	0%
Y≥6 个月	0%	

（注：1 个月=30 日）

本基金转为开放式运作后赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、登记费和其他手续费后的余额归基金财产。对于 A 类基金份额，本基金对持续持有期在 30 日以内的投资人收取的赎回费，全额计入基金资产；对持续持有期在 30 日至 3 个月的投资人收取的赎回费，75%计入基金资产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人的赎回费 50%计入基金资产。对于 C 类基金份额，持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产。

对于每份申购份额，持有期指自该基金份额申购确认日至赎回确认日（不含该日）。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

七、申购份额与赎回金额的计算方式

1.申购金额的计算方式：

（1）A 类基金份额

申购费用适用比例费率的情形下：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T 日 A 类基金份额净值

申购费用适用固定金额的情形下：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-固定金额

申购份额=净申购金额/T 日 A 类基金份额净值

例 1：假定 T 日 A 类基金份额净值为 1.0560 元，某投资人申购本基金 40 万元，对应的申购费率为 1.20%，该投资人可得到的 A 类基金份额为：

净申购金额=400,000/（1+1.20%）＝395,256.92 元

申购费用=400,000- 395,256.92＝4,743.08 元

申购份额=395,256.92/1.0560＝374,296.33 份

即：该投资人投资 40 万元申购本基金，假定申购当日 A 类基金份额净值为 1.0560 元，可得到 374,296.33 份 A 类基金份额。

例 2：假定 T 日 A 类基金份额净值为 1.0560 元，某投资人投资 600 万元申购本基金，其对应的申购费用为 1000 元，则其可得到的申购份额为：

申购费用＝1,000 元

净申购金额＝6,000,000－1,000＝5,999,000.00 元

申购份额＝5,999,000/1.0560＝5,680,871.21 份

即，该投资人投资 600 万元申购本基金，假定申购当日 A 类基金份额净值为 1.0560 元，可得到 5,680,871.21 份 A 类基金份额。

（2）C 类基金份额

申购份额=申购金额/申购当日 C 类基金份额净值

申购份额的计算结果均按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：假设某投资者投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额，申购当日本基金 C 类基金份额净值为 1.0600 元，则可得到的申购份额为：

申购份额＝100,000/1.0600＝94,339.62 份

即：投资者投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日本基金 C 类基金份额净值为 1.0600 元，则其可得到 94,339.62 份 C 类基金份额。

2、赎回金额的计算方式：

赎回总金额=赎回份额×T 日该类基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额—赎回费用

例：某投资者赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，持有时间为三年，对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2500 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.2500=12,500.00 元

赎回费用=12,500×0%=0.00 元

净赎回金额=12,500-0=12,500.00 元

即：投资者赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为三年，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2500 元，则其可得到的赎回金额为 12,500.00 元。

例：假设某投资者赎回 C 类基金份额 100,000 份，持有时间为 1 年，则对应的赎回费率为 0，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.0600 元，则可得到的赎回金额为：

赎回金额＝100,000×1.0600＝106,000.00(元)

赎回费用＝100,000×1.0600×0＝0 （元）

净赎回金额＝106,000.00-0＝106,000.00 （元）

即：投资者赎回本基金 10 万份 C 类基金份额，持有时间为 1 年，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.0600 元，则其可得到的赎回金额为 106,000.00 元。

3、本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后 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。T 日的各类基金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。

4、申购份额余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

5、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

6、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下，且对份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，根据市场情况制定基金促销计划，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基金的申购、赎回费率和销售服务费。

7、本基金封闭期届满转换为开放式运作后，当本基金各类基金份额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。

八、申购与赎回的登记

1、经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资者申购基金成功后，登记机构在 T+1 日为投资者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。

3、投资人赎回基金成功后，登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

4、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者的合法权益，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

九、拒绝或暂停申购的情形

封闭运作期届满转为开放式运作后，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。

3、证券、期货交易所或外汇市场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。

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、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、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。

8、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。

9、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。

10、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、7、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，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。

十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

封闭运作期届满转为开放式运作后，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。

3、证券、期货交易所或外汇市场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。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、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。

6、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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

7、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 4 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 4 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。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。

十一、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)超过前一工作日的基金总份额的 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工作日基金总份额的 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该类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。

（3）本基金发生巨额赎回时，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一工作日基金总份额 10%以上的部分，基金管理人有权对其进行延期办理（被延期赎回的赎回申请，将自动转入下一个开放日继续赎回，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该类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）；对于该基金份额持有人申请赎回的份额中未超过上一工作日基金总份额 10%的部分，基金管理人应在评估是否有能力支付投资人的全部赎回申请后，按照全额赎回或部分延期赎回的方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

（4）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。

十二、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在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。

3、上述暂停申购或赎回情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近 1 个工作日各类基金份额净值。

十三、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。

十四、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，基金管理人履行相关程序后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。

十五、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。

十六、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

十七、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。

十八、基金份额的冻结、解冻与质押

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。

对基金份额持有人无实质不利影响，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。

第八部分　基金的投资

一、投资目标

本基金坚持价值投资理念，充分发挥专业研究与精选个股能力，力争组合资产实现长期稳健的增值。

二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、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、债券回购、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款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）。

如法律法规或中国证监会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。

本基金的投资组合比例为：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 10%—100%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

封闭期届满转为开放式运作后，本基金的股票资产（含存托凭证）占基金资产的 10%-95%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约所需缴纳的交易保证金后，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%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

三、投资策略

本基金为灵活配置混合型基金。投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、其他资产投资策略三个部分内容。其中，资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，动态调整大类资产配置比例，以争取规避系统性风险。其次，股票投资策略包括行业选择和个股选择，在行业选择层面，主要是结合宏观和政策环境判断，形成行业配置思路。在个股投资层面，本基金将坚持估值与成长相结合，对企业基本面和长期竞争力进行严格评判。其他资产投资策略有债券投资策略、股指期货、国债期货投资策略和资产支持证券投资策略。

（一）资产配置策略

本产品将按照风险收益配比原则，实行动态的资产配置。在正常市场情况下，本产品组合投资的基本范围为：封闭运作期内本基金的股票资产投资比例为 10-100%，封闭期届满转为开放式运作后本基金的股票资产占基金资产的 10%-95%；港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%－50%。

本基金大类资产配置的根本，在于对宏观经济景气轮动的研究。本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、货币供应量的绝对水平和增长率、利率水平与走势、外汇占款等）以及国家财政、税收、货币、汇率各项政策，来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向。本基金将基于对经济周期和市场走势的研究，来判断出适合的股票资产和固定收益资产的配置比例。

本基金将基于国内外宏观经济、货币政策、资本市场环境等因素，主动对股票资产进行积极灵活配置。具体而言，本基金将根据股票市场估值水平和上市公司盈利能力变化趋势来决定股票资产的配置比例。

沪深 300 指数整体估值水平在过去 10 年内的历史分位	本月股票资产占基金资产的比例限制（封闭运作期）	本月股票资产占基金资产的比例限制（封闭运作期满转为开放式运作后）
10%分位以下	55%-100%	50%-95%
10%—90%分位	45%-90%	45%-90%
90%分位及以上	10%-55%	10%-55%

（二）股票投资策略

在股票投资上，本基金将在符合经济发展规律、有政策驱动的、推动经济结构转型的新的增长点和产业中，以自下而上的个股选择为主，重点关注公司以及所属产业的成长性与商业模式。

（1）行业选择与配置

行业的选择与配置方面，重点关注三个问题：经济运行所处的周期、产业运行周期、行业成长空间。顺应经济结构转型的变化，寻找推动经济增长的新的驱动力，重点关注行业所处的成长周期，行业的增速以及未来的空间。

（2）竞争力分析

就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有竞争优势，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。本基金强调通过核心竞争力判断上市公司未来盈利增长的潜力。

（3）管理层分析

在国内监管体系落后、公司外部治理结构不完善的基础上，上市公司的命运对管理团队的稳定性及其能力的依赖度大大增加。由此，基金管理人在投资分析中尤其强调对管理层的经营纪录以及管理制度的考查。

（4）财务指标分析

在财务预测的基础上，对公司盈利增长的持续性、回报率相对于资本成本的差异和公司的财务稳健性进行判断。

（5）估值比较

通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和增长性分析，确定具有上升基础的股价水平。

（6）交易策略

通过详实的基础研究以及后续追踪，合理确定投资标的交易价格区间，减少交易的随机性。

（7）港股投资策略

本基金将充分挖掘内地与香港股票市场交易互联互通、资金双向流动机制下 A 股市场和港股市场的投资机会。具体投资策略如下：

第一，通过自主开发的针对港股的以基本面因子为主导的多因子量化模型，以港股通标的为选股池，根据市场流动性和产品规模等实际需求选择因子打分高的标的构建港股通量化优选组合。

第二，对于两地同时上市的公司，考察其折溢价水平，寻找相对于 A 股有异常折价或估值和波动性相对于 A 股更加稳定的 H 股标的。

第三，考察港股通标的股票的行业属性和商业模式，在 A 股暂时无相应标的的行业中寻找估值低且具有成长性的标的。

本基金将持续追踪 A 股市场和港股市场的相对估值和市场情况，适时调整组合中港股通的投资比例。

（8）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。

（三）债券投资策略

本基金采用的债券投资策略包括：期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、可转换债券投资策略等。

1、期限结构策略

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

2、信用策略

信用债收益率等于基准收益率加信用利差，信用利差收益主要受两个方面的影响，一是该信用债对应信用水平的市场平均信用利差曲线走势；二是该信用债本身的信用变化。基于这两方面的因素，本基金管理人分别采用（1）基于信用利差曲线变化策略和（2）基于信用债信用变化策略。

3、互换策略

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

4、息差策略

通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，从而获得杠杆放大收益。

5、可转换债券投资策略

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，再根据可转换债券的特性选择各行业不同的转债券种。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。

（四）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。

（五）资产支持证券投资策略

本基金将通过对资产支持证券基础资产及结构设计的研究，结合多种定价模型，根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。

（六）流通受限证券投资策略

本基金将根据基金管理人的净资本规模，以及本基金的投资风格和流动性特点，兼顾基金投资的安全性、流动性和收益性，合理控制基金投资流通受限证券的比例。

未来随着证券市场投资工具的发展和丰富，在符合有关法律法规规定的前提下，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

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）在封闭运作期内，本基金的股票（含存托凭证）投资比例为基金资产的 10%—100%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；封闭期届满转为开放式运作后，本基金股票（含存托凭证）投资比例为基金资产的 10%-95%；投资于港股通标的股票占股票资产的比例为 0-50%；

（2）在封闭运作期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；本基金封闭期届满转为开放式运作后，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者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；

（3）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%；

（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（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）的 10%；

（5）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%；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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；

（10）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；

（11)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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（12）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）封闭期内的每个交易日日终，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%；本基金封闭期届满转为开放式运作后，每个交易日日终，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；

（13）封闭期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%；本基金封闭期届满转为开放式运作后，本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（14）本基金封闭期届满转为开放式运作后，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%；

（15）本基金封闭期届满转为开放式运作后，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；

（16）本基金封闭期届满转为开放式运作后，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；

（17）本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；

（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（2）、（9）、（15）、（16）情形之外，因证券、期货市场及期货市场波动、证券发行人合并、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，但法律法规或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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，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或按调整后的规定执行，但须提前公告。

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，但是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。

法律、行政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，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

五、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*75%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*10%+中债-国债总财富（1-3 年）指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%。

1、业绩比较基准设定的原因

（1）基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于 A 股股票、港股通股票、债券等资产，相应选取与之匹配的 A 股指数、港股指数、债券指数作为基准要素。同时基于基金投资股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为 10%—100%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%等投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，本基金将股票资产与债券资产所对应的基准要素权重分别设置为 85%与 10%，其中将股票资

产中的 A 股股票与港股通股票所对应的基准要素权重分别设置为 75%与 10%。此外，为应对基金日常流动性需求，本基金会保持一定比例的现金或其他高流动性资产，将高流动性资产所对应的基准要素权重设置为 5%。

（2）基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票资产采用全市场选股策略，关注在符合经济发展规律、有政策驱动的、推动经济结构转型的新的增长点和产业中的行业个股，分析成长性与商业模式，力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的投资回报。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及指数市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，本基金选取沪深 300 指数和中证港股通综合指数（人民币）分别作为 A 股股票和港股通股票部分的基准要素。

沪深 300 指数由沪深市场中规模大、流动性好的最具代表性的 300 只证券组成，反映沪深市场上市公司证券的整体表现。指数样本量大，行业覆盖面广，适合作为本基金 A 股股票部分的业绩比较基准要素。

中证港股通综合指数（人民币）选取符合港股通资格的上市公司证券作为样本，反映港股通范围内上市公司的整体表现，适合作为本基金港股通股票部分的业绩比较基准要素。

（3）基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产预期整体组合久期偏向于中短久期。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，选取中债-国债总财富（1-3 年）指数作为债券部分的业绩比较基准要素。

中债-国债总财富（1-3 年）指数隶属于中债-国债总指数，该指数成份券由在境内公开发行且上市流通、债券待偿期限在 1-3 年（含 1 年）的记账式国债组成，反映中短期限国债的整体价格走势及变动趋势，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

（4）本基金将活期存款基准利率纳入业绩比较基准，对应基金投资的现金类资产，该业绩比较基准要素能准确反映现金类资产的无风险收益水平，与基金现金类资产的投资收益特征高度匹配。

综上，本基金选取的业绩比较基准与基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制相匹配。

2、业绩比较基准要素的基本信息

沪深 300 指数由中证指数有限公司编制发布，指数代码为 000300，指数具体信息详见中证指数有限公司网站，网址：www.csindex.com.cn。

中证港股通综合指数（人民币）由中证指数有限公司编制发布，指数代码为930933，指数具体信息详见中证指数有限公司网站，网址：www.csindex.com.cn。

中债-国债总财富（1-3年）指数由中债金融估值中心有限公司编制发布，指数代码为CBA00621，指数具体信息详见中国债券信息网，网址：www.chinabond.com.cn。

活期存款基准利率由中国人民银行发布，具体信息详见中国人民银行网站，网址：www.pbc.gov.cn。

3、业绩比较基准的计算方法

本基金业绩比较基准收益率的计算方法以每日收益率为基础，以时间加权为计算原则。本基金先分别计算业绩比较基准中沪深300指数、中证港股通综合指数（人民币）、中债-国债总财富（1-3年）指数和活期存款基准利率的每日收益率，再按照预设权重比例计算当日组合要素基准的日收益率，并连乘每日收益率。

4、管理投资偏离业绩比较基准的定性或定量方法

本基金管理人对基金实际投资与业绩比较基准的偏离情况进行动态跟踪与监测评估，监测指标主要包括超额收益、配置偏离等指标，以更好管理基金实际投资与业绩比较基准的偏离情况，从而在控制风险的基础上追求超越业绩比较基准的投资回报。

本基金为主动管理型基金，其业绩比较基准是表征产品风格、衡量产品业绩、约束投资行为的参考标准，并非本基金的跟踪标的。基金管理人在基金合同约定的投资范围、投资限制内享有充分的投资决策自主权，可根据投资策略、市场研判等综合因素，自主构建投资组合，包括酌情投资于业绩比较基准要素成份证券外的证券。本基金投资组合相对业绩比较基准要素成份证券和权重可能存在偏离。

5、未来可能变更业绩比较基准的情况和程序

业绩比较基准变更符合下列条件之一且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，基金管理人应当与基金托管人协商，在新业绩比较基准生效前三十日公告并充分说明变更原因、差异及影响，无需召开基金份额持有人大会：

（1）原有业绩比较基准的要素无法持续运作、编制方案发生重大修订等客观因素导致业绩比较基准无法再表征基金产品投资风格，或不再符合基金合同关于投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制等的约定，或与主要的资产类别、国别或地区、市场板块、货币类型等不再匹配；或业绩比较基准的要素不再具备市场代表性；

（2）调整业绩比较基准的要素权重、更换相同或相近特征的要素等，使新业绩比较基准代表性更强，且符合相关法律法规规定的；

（3）中国证监会认可的其他情形。

业绩比较基准变更涉及以下情形的，基金管理人应当按照规定履行变更注册、召开基金份额持有人大会等程序，法律法规、中国证监会另有规定的除外：

（1）基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例等拟进行重大调整，并变更业绩比较基准的；

（2）其他对基金份额持有人利益产生重大实质性影响的情形。

六、风险收益特征

本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

七、基金管理人代表基金行使相关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相关权利，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。

八、基金投资组合报告

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

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

本投资组合报告所载数据截至 2025 年 6 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	125,836,379.27	86.54
	其中：股票	125,836,379.27	86.54

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	706,281.21	0.49
	其中：债券	706,281.21	0.49
	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	10,695,498.03	7.36
8	其他各项资产	8,173,334.40	5.62
9	合计	145,411,492.91	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额39,653,701.73元，净值占比27.70%。

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	64,430,278.48	45.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,574,142.36	8.78
J	金融业	3,649,594.00	2.55
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,091,416.00	3.56
M	科学研究和技术服务业	11,576.70	0.01
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	425,670.00	0.30
S	综合	-	-
	合计	86,182,677.54	60.20

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（%）
电信业务	499,803.32	0.35
非日常生活消费品	11,198,381.22	7.82

金融	4,812,419.43	3.36
信息技术	17,899,134.47	12.50
医疗保健	5,243,963.29	3.66
合计	39,653,701.73	27.70

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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	1810	小米集团-W	228,600	12,497,882.61	8.73
2	300502	新易盛	94,680	12,026,253.60	8.40
3	9992	泡泡玛特	43,200	10,503,037.58	7.34
4	300308	中际旭创	48,900	7,132,554.00	4.98
5	002384	东山精密	163,700	6,182,949.00	4.32
6	002602	ST 华通	515,880	5,715,950.40	3.99
7	0981	中芯国际	132,500	5,401,251.86	3.77
8	600415	小商品城	246,200	5,091,416.00	3.56
9	002463	沪电股份	114,800	4,888,184.00	3.41
10	1801	信达生物	56,000	4,003,825.28	2.80

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	706,281.21	0.49
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	706,281.21	0.49

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	019758	24 国债 21	7,000	706,281.21	0.49

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

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，浙江世纪华通集团股份有限公司在报告编制前一年受到中国证券监督管理委员会的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	145,531.13
2	应收证券清算款	7,906,121.91
3	应收股利	120,563.41
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,117.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,173,334.40

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第九部分 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

博时荣丰回报灵活配置混合 A

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
2020.05.07-2020.12.31	20.61%	1.19%	17.82%	0.71%	2.79%	0.48%
2021.01.01-2021.12.31	-4.73%	1.08%	-2.15%	0.68%	-2.58%	0.40%
2022.01.01-2022.12.31	-25.49%	1.66%	-10.67%	0.80%	-14.82%	0.86%
2023.01.01-2023.12.31	-11.96%	1.55%	-5.06%	0.52%	-6.90%	1.03%
2024.01.01-2024.12.31	5.73%	1.74%	12.92%	0.75%	-7.19%	0.99%
2025.01.01-2025.06.30	8.21%	1.86%	2.42%	0.65%	5.79%	1.21%
2020.05.07-2025.06.30	-13.76%	1.52%	12.17%	0.70%	-25.93%	0.82%

博时荣丰回报灵活配置混合 C

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
2020.05.07-2020.12.31	20.22%	1.19%	17.82%	0.71%	2.40%	0.48%
2021.01.01-2021.12.31	-5.20%	1.08%	-2.15%	0.68%	-3.05%	0.40%
2022.01.01-2022.12.31	-25.87%	1.66%	-10.67%	0.80%	-15.20%	0.86%
2023.01.01-2023.12.31	-12.39%	1.55%	-5.06%	0.52%	-7.33%	1.03%
2024.01.01-2024.12.31	5.21%	1.74%	12.92%	0.75%	-7.71%	0.99%
2025.01.01-2025.06.30	7.95%	1.86%	2.42%	0.65%	5.53%	1.21%
2020.05.07-2025.06.30	-15.93%	1.52%	12.17%	0.70%	-28.10%	0.82%

第十部分　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。

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。

第十一部分　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、股指期货合约、国债期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

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。

（一）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。

（二）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。

（三）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，最近交易日后经济环境未发生重大变化且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；

（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、配股和公开增发的新股，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，回售登记期截止日（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，一般以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、本基金封闭期届满转为开放式运作后，当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、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，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价格估值。

9、相关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。

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，基金资产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。

五、估值程序

1、各类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该类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。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，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，将各类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，由基金管理人按约定对外公布。

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。当任一类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，视为该类基金份额净值错误。

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。

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）错误偏差达到该类基金份额净值的 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；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

（3）基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

（4）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、期货交易市场或外汇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，基金管理人应当暂停估值；

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

基金资产净值和各类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各类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约定予以公布。

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、期货交易所或登记结算公司等第三方机构发送的数据错误等原因，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。

第十二部分　基金的收益与分配

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、在符合有关基金分红条件的前提下，由基金管理人根据产品特点自行约定收益分配次数、比例等，具体见基金管理人届时发布的相关公告；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资（红利再投资不受封闭期限制）；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定并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。

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者自行承担。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相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

第十三部分　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、C 类基金份额的销售服务费；

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，但法律法规、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、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、账户开户费用、账户维护费用；

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、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 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.20%÷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

基金管理费每日计提，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，基金托管人自动于月初三个工作日内、按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日、不可抗力等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

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

H＝E×0.20%÷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

基金托管费每日计提，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，基金托管人自动于月初三个工作日内、按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日、不可抗力等，支付日期顺延。

3、C 类份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.50%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年销售服务费率÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人自动于月初 3 个工作日内从基金财产按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日、不可抗力等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

上述“一、基金费用的种类”中第 4－11 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、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。

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。

第十四部分　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。

第十五部分　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相关规定发生变化时，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的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《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、基金份额发售公告

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者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者决策的全部事项，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。基金出现终止运作情形的，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。基金出现终止运作情形的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

5、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。

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三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在指定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在指定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在指定网站上。

（二）《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。

（三）基金净值信息

《基金合同》生效后，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、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。

（四）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，并保证投资者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。

（五）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。

（六）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、终止《基金合同》、基金清算；

3、转换基金运作方式（含本基金封闭运作期届满后转为开放式运作）、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、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

6、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；

7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；

8、基金募集期延长或提前结束募集；

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；

11、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；

12、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

13、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；

14、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；

15、基金收益分配事项；

16、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

17、任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；

18、本基金开始办理申购、赎回；

19、本基金发生巨额赎回并延期办理；

20、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；

21、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

22、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；

23、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

24、调整基金份额类别的设置；

25、基金推出新业务或服务；

26、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的和基金合同约定的其他事项。

（七）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。

（八）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。

（九）投资股指期货、国债期货的信息披露

基金管理人应当在基金季度报告、基金中期报告、基金年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货、国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货、国债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等。

（十）投资资产支持证券的信息披露

基金管理人应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。基金管理人应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。

（十一）投资港股通标的股票的信息披露

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中按届时有效的法律法规或监管机构的要求披露本基金参与港股通标的股票交易的相关情况。若中国证监会对公开募集证券投资基金投资港股通标的股票的信息披露另有规定的，从其规定。

（十二）流通受限证券的信息披露

基金管理人应在基金年报及中期报中披露其持有的流通受限证券总额、流通受限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。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的流通受限证券总额、流通受限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 名流通受限证券明细。

（十三）清算报告

基金合同出现终止情形的，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。

（十四）中国证监会规定的其他信息。

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、各类基金份额净值、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。

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。

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，以供社会公众查阅、复制。

八、暂停或延迟信息披露的情形

1、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

2、基金投资所涉及的证券、期货交易所或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

3、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

第十六部分　风险揭示

一、投资于本基金的主要风险

投资于本基金的主要风险有：

1、市场风险

证券市场价格受到各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，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。随着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。本基金主要投资于股票，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。

（4）通货膨胀风险。如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

（5）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（即利率风险）互为消长。

（6）杠杆风险

本资产管理计划可以通过债券回购放大杠杆，进行杠杆操作将会放大组合收益波动，对组合业绩稳定性有较大影响，同时杠杆成本波动也会影响组合收益率水平，在市场下行或杠杆成本异常上升时，有可能导致基金财产收益的超预期下降风险。

（7）波动性风险

波动性风险主要存在于可转债的投资中，具体表现为可转债的价格受到其相对应股票价格波动的影响，同时可转债还有信用风险与转股风险。转股风险指相对应股票价格跌破转股价，不能获得转股收益，从而无法弥补当初付出的转股期权价值。

2、信用风险

信用风险主要指债券、资产支持证券等信用证券发行主体信用状况恶化，导致信用评级下降甚至到期不能履行合约进行兑付的风险，另外，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

3、流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括基金出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

（1）基金申购、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。

封闭期届满后，本基金转为开放式运作，基金名称变更为“博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金”。除此之外，本基金的基金费率，基金的投资范围等均不变。本基金在客户集中度控制、巨额赎回监测及应对在投资者申购赎回方面均明确了管理机制，在接受申购申请对存量客户利益构成潜在重大不利影响，以及市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人在保障投资者合法权益的前提下可按照法律法规及基金合同的规定，审慎确认申购赎回申请并综合运用各类流动性风险管理工具作为辅助措施，全面应对流动性风险。

（2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括国内依法发行上市的股票、债券和货币市场工具等），同时本基金基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

（3）封闭运作期届满后转为开放式运作后巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的，基金管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

（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

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、摆动定价等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与基金托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付

等可能受到相应影响，基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

4、操作风险

操作风险是指基金运作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

5、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不充分、投资操作出现失误等，都会影响基金的收益水平。

6、合规风险

合规风险指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者违反《基金合同》有关规定的风险。

7、本基金的特有风险

（1）港股通机制下，港股投资风险

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪港通机制下允许投资的香港联合交易所（以下简称：“香港联交所”或“联交所”）上市的股票，除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于：

1）市场联动的风险。

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。

2）股价波动的风险。

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，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，本基金持仓的波动风险可能相对较大。

3）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。

4）港股通额度限制

现行的港股通规则，对港股通设有总额度以及每日额度上限的限制；本基金可能因为港股通市场总额度或每日额度不足，而不能买入看好之投资标的进而错失投资机会的风险。

5）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及时买入看好的投资标的，而错失投资机会的风险。

6）港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则，只有沪港两地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。

7）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 A 股和港股投资比例，造成比例超标的风险。

8）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，所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，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。

9）香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联交所规定，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，联交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，在香港联交所市场没有风险警示板，联交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，使得联交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。

10）港股通规则变动带来的风险

本基金是在港股通机制和规则下参与香港联交所证券的投资，受港股通规则的限制和影响；本基金存在因港股通规则变动而带来基金投资受阻或所持资产组合价值发生波动的风险。

11）其他可能的风险

除上述显著风险外，本基金参与港股通投资，还可能面临的其他风险，包括但不限于：

①除因股票交易而发生的佣金、交易征费、交易费、交易系统费、印花税、过户费等税费外，在不进行交易时也可能要继续缴纳证券组合费等项费用，本基金存在因费用估算不准而导致账户透支的风险；

②在香港市场，部分中小市值港股成交量则相对较少，流动较为缺乏，本基金投资此类股票可能因缺乏交易对手而面临个股流动性风险；

③在本基金参与港股通交易中若香港联交所与内地交易所的证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，可能导致 15 分钟以上不能申报和撤销申报的交易中断风险；

④存在港股通香港结算机构因极端情况下无法交付证券和资金的结算风险；另外港股通境内结算实施分级结算原则，本基金可能面临以下风险：（一）因结算参与人未完成与中国结算的集中交收，导致本基金应收资金或证券被暂不交付或处置；（二）结算参与人对本基金出现交收违约导致本基金未能取得应收证券或资金；（三）结算参与人向中国结算发送的有关本基金的证券划付指令有误的导致本基金权益受损；（四）其他因结算参与人未遵守相关业务规则导致本基金利益受到损害的情况。

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。

（2）股指期货、国债期货投资风险

本基金将股指期货纳入到投资范围中，股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。同时，股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给基金净值带来重大损失。

本基金投资国债期货，国债期货市场的风险类型较为复杂，涉及面广，具有放大性与可预防性等特征。其风险主要有由利率波动原因造成的市场价格风险、由宏观因素和政策因素变化而引起的系统风险、由市场和资金流动性原因引起的流动性风险、由交易制度不完善而引发的制度性风险以及由技术系统故障及操作失误造成的技术系统风险等。

（3）资产支持证券（ABS）的风险

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。

（4）基金合同生效后三年之内（含三年）为封闭期。在封闭期内，本基金不接受基金份额的申购和赎回，也不上市交易。本基金封闭期届满转为开放式运作后，投资人方可在本基金的开放日办理基金份额的申购和赎回。

（5）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。

8、操作或技术风险

（1）技术风险：在定向资产管理业务的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等。

（2）操作风险：证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

9、其它风险

（1）战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致委托财产的损失；

（2）金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致资产委托人利益受损。

二、声明

1、投资者投资于本基金，须自行承担投资风险；

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金销售机构销售，基金管理人与其他销售机构都不能保证其收益或本金安全。

第十七部分　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，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 个工作日内成立基金财产清算小组，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。

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、基金合并

本基金与其他基金的合并应当按照法律法规规定的程序进行。

第十八部分　基金合同的内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）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者的利益；

（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）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；

（14）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；

（15）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、定期定额投资和非交易过户等业务规则；

（16）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，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、中期和年度基金报告；

（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》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

（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者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《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条件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。

（二）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，如发现基金管理人有违反《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者的利益；

（4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券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》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

（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、中期和年度基金报告出具意见，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；如果基金管理人有未执行《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。

（三）基金份额持有人

基金投资者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，基金投资者自依据《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。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。基金 A 类基金份额与 C 类基金份额由于基金份额净值的不同，基金收益分配的金额以及参与清算后的剩余基金财产分配的数量将可能有所不同。

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同一类别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。

（一）召开事由

1、除法律法规和中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定外，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：

（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（不包括本基金封闭运作期届满后转为开放式运作）；

（5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率；

（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）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；

（12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（13）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；

（2）调整本基金的申购费率、调低赎回费和销售服务费或变更收费方式，调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整；

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（4）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；

（5）基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

（6）履行相关程序后，基金推出新业务或服务；

（7）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，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、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、监管机构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形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、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。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。

（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一票表决权。

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、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并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，除非在计票时监督员及公证机关均认为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者身份文件的表决视为有效出席的投资者，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，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 个工作日内成立基金财产清算小组，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。

（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）基金合并

本基金与其他基金的合并应当按照法律法规规定的程序进行。

四、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，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

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（为本基金合同之目的，不含港澳台地区）法律管辖。

五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

第十九部分　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：518040

法定代表人：张东

成立日期：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

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。

（二）基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：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

邮政编码：100033

法定代表人：张金良

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付

款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、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、债券回购、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款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）。

如法律法规或中国证监会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。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

本基金的投资组合比例为：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 10%—100%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

封闭期届满转为开放式运作后，本基金的股票资产（含存托凭证）占基金资产的 10%-95%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约所需缴纳的交易保证金后，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%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）在封闭运作期内，本基金的股票（含存托凭证）投资比例为基金资产的 10%—100%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；封闭期届满转为开放式运作后，本基金股票（含存托凭证）投资比例为基金资产的 10%-95%；投资于港股通标的股票占股票资产的比例为 0-50%；

（2）在封闭运作期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；本基金封闭期届满转为开放式运作后，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者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；

（3）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%；

（4）本基金管理人管理的且在本基金托管人处托管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）的 10%；

（5）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%；

（6）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%；

（7）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%；

（8）本基金管理人管理的且在本基金托管人处托管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%；

（9）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；

（10）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；

（11）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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（12）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）封闭期内的每个交易日日终，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%；本基金封闭期届满转为开放式运作后，每个交易日日终，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；

本基金在开始进行期货投资之前，应与基金托管人、期货公司三方一同就期货开户、清算、估值、交收等事宜另行签署《期货投资托管操作三方备忘录》。本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人、期货公司三方一同就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行签署协议《期货投资托管操作三方备忘录》。

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；

（13）封闭期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%；本基金封闭期届满转为开放式运作后，本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（14）本基金封闭期届满转为开放式运作后，本基金管理人管理的且在本基金托管人处托管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且在本基金托管人处托管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%；

（15）本基金封闭期届满转为开放式运作后，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；

（16）本基金封闭期届满转为开放式运作后，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；

（17）本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；

（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（2）、（9）、（15）、（16）情形之外，因证券、期货市场及期货市场波动、证券发行人合并、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，但法律法规或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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，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或按调整后的规定执行，但须提前公告。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对本托管协议第十五条第（九）款基金投资禁止行为通过事后监督方式进行监督。

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其他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。

法律、行政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，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、各类基金份额净值计算、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。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

1.本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、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。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的流通受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的流通受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因流通受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资流通受限证券，不得预付任何形式的保证金。

2.基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资流通受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资流通受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

3.本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

（1）中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

（2）非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

（3）非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

（4）基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4.基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒体披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资流通受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应按规定编制临时报告书，予以公告。

5.基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

（1）本基金投资流通受限证券时的法律法规遵守情况。

（2）在基金投资流通受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

（3）有关比例限制的执行情况。

（4）信息披露情况。

6.相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

（六）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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。

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

（八）若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

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

三、基金管理人对基金托管人的业务核查

（一）基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和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各类基金份额净值、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。

（二）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、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》、本协议及其他有关规定时，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并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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。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。

（三）基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金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。

3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券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，独立核算，确保基金财产的完整与独立。

5.基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、开户银行或交易/登记结算机构扣收交易费、结算费和账户维护费等费用）。

6.对于因为基金投资产生的应收资产，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账户的，基金托管人应及时通知并配合基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对基金管理人的追偿行为应予以必要的协助与配合，但对基金财产的损失不承担任何责任。

7.除依据法律法规和《基金合同》的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

（二）基金募集期间及募集资金的验资

1.基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在具有托管资格的商业银行开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2.基金募集期满或基金停止募集时，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，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

3.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等事宜。

（三）基金银行账户的开立和管理

1.基金托管人应以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

2.基金银行账户的开立和使用，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假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3.基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4.在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

（四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1.基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2.基金证券账户的开立和使用，仅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或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。

3.基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

证券账户开户费由本基金财产承担。此项开户费由基金管理人先行垫付，待本基金启始运营后，基金管理人可向基金托管人发送划款指令，将代垫开户费从本基金托管资金账户中扣还基金管理人。

4.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开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算保证金、交收资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定以及基金管理人与基金托管人签署的《托管银行证券资金结算协议》执行。

5、账户注销时，在遵守中国证券登记结算公司的相关规定下，由管理人和托管人协商确认主要办理人。账户注销期间，主要办理人如需另一方提供配合的，另一方应予以配合。

6.若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

（五）债券托管账户的开设和管理

《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；基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，持有人账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

（六）其他账户的开立和管理

1.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，由基金管理人协助基金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。

2.法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司/北京分公司、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让，按基金管理人和基金托管人双方约定办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制或保管的资产不承担任何责任。

（八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为《基金合同》终止后 15 年，法律法规或监管部门另有规定的除外。

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合同传真件并加盖公章，未经双方协商一致，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、复核与完成的时间及程序

1.基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。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。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

2.基金管理人应每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，将各类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，由基金管理人按约定对外公布。

（二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

1.估值对象

基金所拥有的股票、股指期货合约、国债期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

2.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。

3.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，最近交易日后经济环境未发生重大变化且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；

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、配股和公开增发的新股，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，回售登记期截止日（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，一般以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）本基金封闭期届满转换为开放式运作后，当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）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，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价格估值。

（9）相关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。

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，基金资产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，仍无法达成一致意见的，基金管理人向基金托管人出具盖章的书面说明后，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

4.特殊情形的处理

基金管理人、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份额净值错误处理。

由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所或登记结算公司等第三方机构发送的数据错误等原因，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。

（三）基金份额净值错误的处理方式

1.当任一类基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生差错时，视为该类基金份额净值错误；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.错误偏差达到该类基金份额净值的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；错误偏差达到该类基金份额净值的0.50%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

3.当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

(1)本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

(2)若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，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，基金管理人与基金托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

(3)如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

(4)由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

4.由于证券、期货交易所及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力等原因，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而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金

托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

5.基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

6.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，基金管理人和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。

（四）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场或外汇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，基金管理人应当暂停估值；

4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

（六）基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人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。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资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

（七）基金财务报表与报告的编制和复核

1.财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

2.报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

3.财务报表的编制与复核时间安排

(1)报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起两个月内完成基金中期报告的编制；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。《基金合同》生效不足两个月的，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。

(2)报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在复核过程中，发现双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，调整以国家有关规定为准。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

（八）基金管理人应在编制季度报告、中期报告或者年度报告之前及时向基金托管人提供基金业绩比较基准编制结果。

六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应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分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年，法律法规或监管部门另有规定的除外。如不能妥善保管，则按相关法律法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。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。

七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，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，仲裁地点为北京市，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。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，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，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本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，不包括香港特别行政区、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

（一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，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报中国证监会备案。

（二）托管协议终止的情形

1.《基金合同》终止；

2.基金托管人解散、依法被撤销、破产或由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、破产或由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。

第二十部分　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。基金管理人不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；也可直接拨打博时一线通 95105568（免长途话费）订阅。

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

电子信箱：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。

第二十一部分 其他应披露的事项

（一）、2025 年 8 月 29 日，我公司公告了《博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金 2025 年中期报告》；

（二）、2025 年 8 月 7 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告》；

（三）、2025 年 7 月 21 日，我公司公告了《博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告》；

（四）、2025 年 6 月 26 日，我公司公告了《博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金（博时荣丰回报灵活配置混合 A）基金产品资料概要更新》、《博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金（博时荣丰回报灵活配置混合 C）基金产品资料概要更新》；

（五）、2025 年 6 月 6 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250606》；

（六）、2025 年 6 月 3 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250603》；

（七）、2025 年 4 月 22 日，我公司公告了《博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告》；

（八）、2025 年 4 月 8 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于运用公司固有资金投资旗下公募基金的公告》、《博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250408》；

（九）、2025 年 3 月 31 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》、《博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金 2024 年年度报告》；

（十）、2025 年 3 月 25 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250325》；

（十一）、2025 年 1 月 22 日，我公司公告了《博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告》；

（十二）、2024 年 12 月 27 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下 78 只基金改聘会计师事务所的公告》；

（十三）、2024 年 12 月 7 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》；

（十四）、2024 年 11 月 18 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告》；

（十五）、2024 年 11 月 14 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告》；

（十六）、2024 年 11 月 6 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20241106》；

（十七）、2024 年 10 月 25 日，我公司公告了《博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告》；

（十八）、2024 年 9 月 30 日，我公司公告了《博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书》；

（十九）、2024 年 9 月 25 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20240925》；

（二十）、2024 年 9 月 21 日，我公司公告了《博时基金管理有限公司关于董事会成员变更的公告》。

第二十二部分　招募说明书存放及查阅方式

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，投资人可在办公时间查阅；投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资人还可以直接登录基金管理人的网站（www.bosera.com）查阅和下载招募说明书。

第二十三部分　备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

（一）中国证监会准予博时荣丰回报三年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

（二）《博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

（三）《博时荣丰回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

（四）基金管理人业务资格批件、营业执照

（五）基金托管人业务资格批件、营业执照

（六）关于申请募集博时荣丰回报三年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金之法律意见

（七）中国证监会要求的其他文件

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

博时基金管理有限公司

2026 年 9 月 21 日