博时中证800证券保险指数分级证券投资基金之证保A级和证保B级份额上市交易公告书

基金管理人：博时基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：　深圳证券交易所
上市时间：　2015年5月28日
公告日期：　2015年5月25日

一、重要声明与提示

《博时中证800证券保险指数分级证券投资基金之证保A级和证保B级份额上市交易公告书》（以下简称“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，博时中证800证券保险指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和深圳证券交易所（以下简称“深交所”）对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在在2015年4月22日的《中国证券报》和2015年4月27日的《上海证券报》及博时基金管理有限公司网站（www.bosera.com）上公告的《博时中证800证券保险指数分级证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金简称：博时证券保险指数分级基金(LOF)

2、基金类型：股票型

3、基金运作方式：契约型开放式

4、本基金的基金份额包括博时证券保险指数分级证券投资基金之基础份额（场内简称：博时证保，基金代码：160516）、博时证券保险指数分级基金之A份额（场内简称：证保A级，基金代码：150225）、博时证券保险指数分级基金之B份额（场内简称：证保B级，基金代码：150226）。其中，证保A级份额、证保B级份额的基金份额配比始终保持1∶1的比例不变。

5、本基金的存续期限为不定期。

6、博时证券保险指数分级证券投资基金之基础份额的申购和赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对本基金进行申购与赎回。场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位，具体销售网点和会员单位的名单由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。证保A级份额与证保B级份额只上市交易，不接受申购和赎回。

7、博时证券保险指数分级证券投资基金之基础份额的跨系统转托管：通过场内、场外方式认购本基金的基金份额持有人可以通过认购本基金的销售机构办理跨系统转托管业务。

8、份额配对转换是指博时证保份额与证保A级份额、证保B级份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括基金份额的分拆和合并两个方面。分拆是指基金份额持有人将其持有的场内博时证保份额按照2份场内博时证保份额对应1份证保A级份额与1份证保B级份额的比例进行转换的行为；基金份额的合并，指基金份额持有人将其持有的证保A级份额与证保B级份额按照1份证保A级份额与1份证保B级份额对应2份场内博时证保份额的比例进行转换的行为。

本基金的场内份额可以直接申请分拆与合并，场外份额通过跨系统转托管至场内后方可申请分拆与合并。

9、定期份额折算

定期折算基准日为本基金存续期内每个会计年度12月份的第一个工作日；若本基金在某定期折算基准日前1个月内发生过不定期折算，基金管理人可选择不进行该次定期折算，具体详见基金管理人届时发布的公告。

在基金份额折算前与折算后，证保A级份额与证保B级份额的份额配比保持1:1的比例。对于证保A级份额的约定应得收益，即证保A级份额每个定期折算基准日基金份额参考净值超出1.0000元部分，将折算为场内博时证保份额分配给证保A级份额持有人。博时证保份额持有人持有的每2份博时证保份额将按1份证保A级份额获得新增博时证保份额的分配。持有场外博时证保份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外博时证保份额的分配；持有场内博时证保份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内博时证保份额的分配。经过上述份额折算，证保A级份额的基金份额参考净值调整为1.0000元，博时证保份额的基金份额净值将相应调整。

10、不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行份额折算，即当博时证保B份额的份额参考净值小于等于0.2500或博时证保份额净值大于等于1.5000元人民币时，由基金管理人确定的基金份额折算日进行不定期份额折算。

当达到不定期折算条件时，本基金将分别对博时证保份额、证保A级份额、证保B级份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保证保A级份额与证保B级份额的比例为1:1，份额折算后博时证保份额的基金份额净值、证保A级份额与证保B级份额的基金份额参考净值均调整为1.0000元。

11、基金份额总额：截止2015年5月21日，本基金的基金份额总额为832,958,860.94份，其中，博时证保份额474,152,757.94份，证保A级份额为179,403,051份，证保B级份额为179,403,052份。

12、基金份额参考净值：截止2015年5月21日，博时证保份额的基金份额净值为1.0000元，证保A级份额的基金份额参考净值为1.0005元，证保B级份额的基金份额参考净值为0.9996元。

13、本次上市交易的基金份额简称：证保A级，基金代码：150225；证保B级，基金代码：150226.

14、本次上市交易的基金份额总额：证保A级179,403,051份，证保B级179,403,052份（截止2015 年5月21日）

15、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

16、上市交易日期：2015年5月28日

17、基金管理人：博时基金管理有限公司

18、基金托管人：中国银行股份有限公司

19、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本次基金上市前的募集

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2015]383号

2、基金运作方式：契约型

3、基金合同期限：不定期

4、发售日期：自2015年4月27日起至2015年5月12日止

5、发售价格：1.00 元人民币

6、发售方式：交易所（场内）和柜台（场外）

7、发售机构：

（1）场外销售机构：

1）直销机构：博时基金管理有限公司直销中心

2）代销银行：中国银行、交通银行、招商银行、浦东发展银行、上海农商行、东莞银行、汉口银行、东莞农商行、河北银行、平安银行、民生银行、中信银行。

3）代销券商：国泰君安、中信建投、招商证券、中信证券、银河证券、海通证券、申万宏源、长江证券、中信证券（浙江）、湘财证券、万联证券、渤海证券、华泰证券、山西证券、中信证券（山东）、东兴证券、东吴证券、信达证券、方正证券、长城证券、光大证券、广州证券、东北证券、大同证券、华安证券、国都证券、东海证券、恒泰证券、国盛证券、申万宏源西部证券、齐鲁证券、世纪证券、西部证券、华龙证券、中金公司、财通证券、华鑫证券、中投证券、中山证券、联讯证券、江海证券、华宝证券、财达证券、广发证券、安信证券、平安证券、华西证券。

4）第三方销售机构：众禄基金、上海天天基金、好买基金、数米基金、一路财富、天相投顾。

（2）场内销售机构：

场内销售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位，具体名单可在深交所网站查询。

8、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司（特殊普通合伙）

9、募集资金总额及入账情况：本次基金发售确认的净认购金额为832,694,010.14元，认购款产生的利息为265,711.54元；上述资金及场外有效认购资金产生的利息222,747.80元已于2015年5月18日全额划入本基金在基金托管人处开立的基金托管专户；场内有效认购资金产生的利息42,963.74元将于下一银行结息日（2015年6月20日）后划付至基金托管账户及结算备付金账户。。

本基金通过场外、场内两种方式公开发售，本次募集有效认购总户数为6991户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，募集期募集资金及利息结转的基金份额共计832,958,860.94份，其中场外认购的基金份额为474,152,757.94份；场内认购的基金份额为358,806,103份。

10、本基金募集备案情况：根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《博时中证800证券保险指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，本基金募集结果符合备案条件，博时基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2015年5月19日获中国证监会书面确认，本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

11、基金合同生效日：2015年5月19日

12、基金合同生效日的基金份额总额：832,958,860.94份。

（二）基金上市交易的主要内容

1、本基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2015]220号

2、上市交易日期：2015年5月28日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基础份额简称及代码：博时证保份额，场内简称：博时证保，基金代码：160516。

上市交易份额简称及代码：证保A级，基金代码：150225；证保B级，基金代码：150226。

5、本次上市交易份额：证保A级179,403,051份；证保B级179,403,052份（截止2015 年5月21日）。

6、基金资产净值的披露：开放式基金每日收市后对基金资产净值进行的估值

基金管理人每个开放日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所，深交所于次日通过行情系统“市盈率Ⅰ”揭示。根据《基金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人对公布的基金净值负责。

7、未上市交易份额的流通规定：对于托管在场内的博时证保份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为证保A级份额和证保B级份额即可上市流通；对于托管在场外的份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为证保A级份额和证保B级份额即可上市流通。

8、本基金开通跨系统转托管业务日期：2015年5月28日，具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）基金份额持有情况

截至2015年5月21日的博时中证800证券保险指数分级基金份额持有情况：

博时证保份额持有人户数为5454户，平均每户持有的基金份额为86,936.7份；证保A级为1534户，平均每户持有的基金份额为116,951.14份；证保B级为1534户，平均每户持有的基金份额为116,951.14份。

机构投资者持有的本次上市交易的证保A级与证保B级的基金份额分别为13,282,668份和13,282,667份，分别占本次证保A级与证保B级上市交易基金份额比例为7.4038%和7.4038%；个人投资者持有的本次上市交易的证保A级与证保B级的基金份额分别为166,120,383份和166,120,385份，分别占本次证保A级与证保B级上市交易基金份额比例为92.5962%和92.5962%。

（二）截止2015年5月21日，本次上市交易的证保A级份额和证保B级份额前十名持有人情况：

序号	持有人名称（全称）	持有证保A级份额	占证保A级份额比(%)	持有证保B级份额	占证保B级份额比(%)
1	西南证券股份有限公司	10,000,194	5.57	10,000,194	5.57
2	于晓莉	3,744,400	2.09	3,744,400	2.09
3	薛清余	2,580,376	1.44	2,580,376	1.44
4	盛耀东	2,505,194	1.40	2,505,195	1.40
5	庄志坪	2,505,048	1.40	2,505,049	1.40
6	王晶	2,500,365	1.39	2,500,364	1.39
7	李星影	2,000,331	1.11	2,000,330	1.11
8	李光英	2,000,291	1.11	2,000,292	1.11
9	金献芳	2,000,194	1.11	2,000,194	1.11
10	孙桂芸	2,000,038	1.11	2,000,038	1.11
	合计	31,836,431		31,836,432	

注：由于四舍五入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

（三）截止到2015年5月21日，基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况

本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为0.00份，占该基金总份额的比例为0%。其中，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量为0.00份，该只基金的基金经理持有该只基金份额总量为0.00份。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：博时基金管理有限公司

2、法定代表人：洪小源

3、总裁：王德英（代）

4、注册资本：2.5亿元人民币

5、注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层

6、设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]26号

7、工商登记注册的法人营业执照文号：440301103465194号

8、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（涉及行政许可的凭许可证经营）

9、股权结构：目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份49%；中国长城资产管理公司，持有股份25%；璟安股权投资有限公司，持有股份12%；天津港（集团）有限公司，持有股份6%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份2%。

10、内部组织结构及职能：

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的合法权益。公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设三大总部和十五个直属部门，分别是：权益投资总部、固定收益总部、市场销售总部以及宏观策略部、交易部、指数投资部、特定资产管理部、年金投资部、产品规划部、互联网金融部、董事长办公室、总裁办公室、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、风险管理部和监察法律部。

权益投资总部负责公司所管理资产的权益投资管理及相关工作。权益投资总部下设股票投资部（含各投资风格小组）、研究部。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。研究部负责完成对宏观经济、投资策略、行业上市公司及市场的研究。固定收益总部负责公司所管理资产的固定收益投资管理及相关工作。固定收益总部下设现金管理组、公募基金组、专户组、国际组和研究组，分别负责各类固定收益资产的研究和投资工作。市场销售总部负责公司全国范围内的客户、销售和服务工作。市场销售总部下设机构与零售两大业务线和营销服务部。机构业务线含战略客户部、机构－上海、机构－南方三大区域和养老金部、券商业务部两个部门。战略客户部负责北方地区由国资委和财政部直接管辖企业以及该区域机构客户的销售与服务工作。机构－上海和机构－南方分别主要负责华东地区、华南地区以及其他指定区域的机构客户销售与服务工作。养老金业务部负责养老金业务的研究、拓展和服务等工作。券商业务部负责券商渠道的开拓和销售服务。零售业务线含零售－北京、零售－上海、零售－南方三大区域，以及客户服务中心。其中，零售三大区域负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。客户服务中心负责零售客户的服务和咨询工作。营销服务部负责营销策划、总行渠道维护和销售支持等工作。

宏观策略部负责为投委会审定资产配置计划提供宏观研究和策略研究支持。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。指数投资部负责公司各类指数投资产品的研究和投资管理工作。特定资产管理部负责公司权益类特定资产专户和权益类社保投资组合的投资管理及相关工作。年金投资部负责公司所管理企业年金等养老金资产的投资管理及相关工作。产品规划部负责新产品设计、新产品报批、主管部门沟通维护、产品维护以及年金方案设计等工作。互联网金融部负责公司互联网金融战略规划的设计和实施，公司互联网金融的平台建设、业务拓展和客户运营，推动公司相关业务在互联网平台的整合与创新。董事长办公室专门负责股东会、董事会、监事会及董事会各专业委员会各项会务工作；股东关系管理与董、监事的联络、沟通及服务；基金行业政策、公司治理、战略发展研究；与公司治理及发展战略等相关的重大信息披露管理；政府公共关系管理；党务工作；博时慈善基金会的管理及运营等。总裁办公室负责公司的战略规划研究、行政后勤支持、会议及文件管理、公司文化建设、品牌传播、对外媒体宣传、外事活动管理、档案管理及工会工作等。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、员工沟通、人力资源信息管理工作。财务部负责公司预算管理、财务核算、成本控制、财务分析等工作。信息技术部负责信息系统开发、网络运行及维护、IT系统安全及数据备份等工作。基金运作部负责基金会计和基金注册登记等业务。风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察，并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。

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

11、人员情况：

截止到2015年3月30日，公司总人数396人，其中研究员和基金经理超过94%拥有硕士及以上学位。

12、信息披露负责人：孙麒清

电话：0755－83169999

13、本基金基金经理

赵云阳，硕士，指数投资部。2003年至2010年在晨星中国研究中心工作。2010年8月加入博时基金，历任股票投资部量化分析师、博时标普500指数基金和博时深证基本面200ETF基金及其联接基金基金经理助理、博时特许价值股票基金基金经理（2013年9月13日至2015年2月9日）。现任博时深证基本面200ETF及其联接基金基金经理（2012年11月13日起至今）、上证企债30ETF基金基金经理（2013年7月11日起至今）。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管业务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：王永民

客服电话：95566

传真：（010）66594942

2、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

3、证券投资基金托管情况

截至2014年9月30日，中国银行已托管293只证券投资基金，其中境内基金268只，QDII基金25只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（三）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17 号

法定代表人：周明

联系电话：（010）59378888

传真：（010）59378907

联系人：朱立元

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼

首席合伙人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

传真电话：（021）23238800

经办注册会计师：薛竞、沈兆杰

联系人：沈兆杰

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用。

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

博时中证800证券保险指数分级证券投资基金（LOF）2015年5月21日资产负债表如下：

博时中证800证券保险指数分级证券投资基金（LOF）

资　　产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
资 产：		负债:	
银行存款	832,916,757.94	短期借款	-
结算备付金	-	交易性金融负债	-
存出保证金	-	衍生金融负债	-
交易性金融资产	-	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	-	应付证券清算款	-
债券投资	-	应付赎回款	-
	-	应付管理人报酬	45,644.17
	-	应付托管费	10,041.72
衍生金融资产	-	应付销售服务费	-
买入返售金融资产	-	应付交易费用	-
应收证券清算款	-	应付税费	-
应收利息	88,159.20	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	6,133.19
其他资产	42,963.74	负债合计	61,819.08
		所有者权益：	
		实收基金	832,958,860.94
		未分配利润	27,200.86
		所有者权益合计	832,986,061.80
资产合计:	833,047,880.88	负债与持有人权益总计：	833,047,880.88

（注：报告截止日2015年5月21日，博时中证800证券保险指数分级证券投资基金基金份额总额为832,958,860.94份，其中母基金份额的基金份额净值为1.0000元，基金份额总额为474,152,757.94份；证保A级份额的基金份额参考净值为1.0005元，基金份额总额为179,403,051.00份；证保B级份额的基金份额参考净值为0.9996元，基金份额总额为179,403,052.00份。

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即2015年5月21日，博时中证800证券保险指数分级证券投资基金（LOF）的投资组合如下：

1、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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	832,916,757.94	99.98
6	其他各项资产	131,122.94	0.02
7	合计	833,047,880.88	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

1、指数投资按行业分类的股票投资组合

注：截至2015年5月21日，本基金未持有指数投资的股票。

2、积极投资按行业分类的股票投资组合

注：截至2015年5月21日，本基金未持有积极投资的股票。

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

1、指数投资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

注：截至2015年5月21日，本基金未持有指数投资的股票。

2、积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：截至2015年5月21日，本基金未持有积极投资的股票。

持有积极投资的股票。

（四）按券种分类的债券投资组合

注：截至2015年5月21日，本基金未持有债券。

（五）按公允价值占净值比例大小排序的前五名债券明细

注：截至2015年5月21日，本基金未持有债券。

（六）按公允价值占净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：截至2015年5月21日，本基金未持有资产支持证券。

（七）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

截至2015年5月21日，本基金未持有贵金属。

（八）按公允价值占净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：截至2015年5月21日，本基金未持有权证。

（九）本基金投资的股指期货交易情况说明

注：截至2015年5月21日，本基金未持有股指期货。

（十）本基金投资的国债期货交易情况说明

注：截至2015年5月21日，本基金未持有国债期货。

（十一）投资组合报告附注

1、截至2015年5月21日，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	88,159.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	42,963.74
9	合计	131,122.94

4、截至2015年5月21日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、截至2015年5月21日，本基金指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明。

注：截至2015年5月21日，本基金未持有指数投资的股票。

6、截至2015年5月21日，本基金积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

截至2015年5月21日，本基金未持有积极投资的股票。

7、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。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，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。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

（一）中国证监会核准博时中证800证券保险指数分级证券投资基金（LOF）募集的文件；

（二）《博时中证800证券保险指数分级证券投资基金（LOF）基金合同》；

（三）《博时中证800证券保险指数分级证券投资基金（LOF）招募说明书》；

（四）《博时中证800证券保险指数分级证券投资基金（LOF）托管协议》；

（五）法律意见书；

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（八）中国证监会要求的其他文件。

博时基金管理有限公司
2015年5月25日

附件：基金合同摘要

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与赎回申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

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

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

（2）办理基金备案手续；

（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，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、半年度和年度基金报告；

（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，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

（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，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、博时证保A份额和博时证保B份额的基金份额参考净值、博时证保份额申购、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、半年度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）建立并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）基金份额持有人的权利和义务

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法申请赎回其持有的博时证保份额、依法转让其持有的博时证保A份额和博时证保B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）缴纳基金认购、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。基金份额持有人大会的审议事项应分别由博时证保份额、博时证保A份额、博时证保B份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

（一）召开事由

1、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；

（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）终止博时证保A份额与博时证保B份额的运作；

（11）终止博时证保A份额与博时证保B份额上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；

（12）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（13）单独或合计持有本基金博时证保份额、博时证保A份额、博时证保B份额各自份额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；

（14）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（14）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、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）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内并对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调低博时证保份额的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

（4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（5）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；

（6）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以外的其他情形。

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

5、单独或合计持有本基金博时证保份额、博时证保A份额、博时证保B份额各自份额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，单独或合计持有本基金博时证保份额、博时证保A份额、博时证保份额B各自份额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，在指定媒介进行公告。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、书面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、通讯开会方式等法律法规及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，有效的博时证保份额、博时证保A 份额与博时证保B份额的基金份额不少于在权益登记日各自基金总份额的二分之一（含二分之一）。参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，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，应当有代表博时证保份额、博时证保A 份额与博时证保B各自基金份额三分之一以上（含三分之一）的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

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在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

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）到指定地点对书面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书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的博时证保份额、博时证保A份额、博时证保B份额基金份额不小于在权益登记日各自基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的博时证保份额、博时证保A份额、博时证保B份额小于在权益登记日各自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博时证保份额、博时证保A份额、博时证保B份额各自基金份额的基金份额持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面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，具体方式在会议通知中列明。

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5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博时证保份额、博时证保A份额、博时证保B份额的各自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博时证保份额、博时证保A份额、博时证保B份额的各自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、博时证保A份额与博时证保B份额终止运作以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资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书面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，但应当计入出具书面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书面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起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在指定媒介上公告。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、表决条件等的规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（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表决通过之日起生效，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

2、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。

3、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。

4、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。

5、基金财产清算的期限为6个月。

（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，根据基金合同终止日博时证保份额的基金份额净值、博时证保A份额与博时证保B份额各自的基金份额参考净值分别计算博时证保、博时证保A与博时证保B三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在博时证保份额、博时证保A份额与博时证保B份额各自类别内，按照基金份额持有人实际持有上述各类别基金份额占该类别份额总额的比例进行分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会备案，在本基金的博时证保A份额与博时证保B份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则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。

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，仲裁费用由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

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，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

（本页无正文，为博时中证800证券保险指数分级证券投资基金之证保A级份额与证保B级份额上市交易公告书的签署页）

博时基金管理有限公司
2015年5月25日

博时中证银行指数分级证券投资基金上网发售提示性公告

经中国证监会批准，博时中证银行指数分级证券投资基金在深圳证券交易所上网发售。所有具有基金销售业务资格且同时为深圳证券交易所会员单位的证券公司的营业部均可办理认购，基金简称“博时银行”，基金代码160517，深圳证券交易所挂牌价1.000元，发售时间 2015年5月25日至2015年6月5日（周六、周日和节假日不受理）。发售截止时间如有变更，基金管理人将及时公告。

博时基金管理有限公司
2015年5月25日