博时抗通胀增强回报证券投资基金更新招募说明书摘要

博时抗通胀增强回报证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监会2011年3月4日证监许可[2011]324号文核准募集,本基金的基金合同于2011年4月25日正式生效,本基金为基金中的基金。

重要提示

本基金经中国证监会2011年3月4日证监许可[2011]324号文核准募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整,本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资者认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

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

基金招募说明书自基金合同生效日起,每6个月更新一次,并于每6个月结束之日后的45日内公告,更新内容截至每6个月的最后1日。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2015年04月25日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年3月31日(财务数据未经审计)。

一、基金的名称

博时抗通胀增强回报证券投资基金。

二、基金的类型

基金中基金。

三、基金的投资目标

本基金通过进行全球大类资产配置,投资于通胀(通缩)相关的各类资产,在有效控制风险的前提下,力争为投资者资产提供通胀(通缩)保护,同时力争获取较高的超额收益。

四、基金的投资方向

本基金主要投资于具有良好流动性的境外相关金融工具。

主要投资范围具体包括:银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;境外证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证;法律法规允许的、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(包括ETF);与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品;远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品;中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

本基金的基金投资(含ETF)比例不低于基金资产的60%,其中不低于80%投资于抗通胀相关主题的基金,除基金投资外的其他投资包括股票等权益类资产、债券等固定收益类资产、现金、货币市场工具、权证、期权、期货、远期、互换等金融衍生产品以及相关法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具投资比例合计不高于基金资产的40%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。抗通胀相关主题的基金主要包括大宗商品类ETF,可细分为跟踪大宗商品综合指数、跟踪分类大宗商品指数如贵金属类、农产品类、能源类和工业金属类等或单个商品的ETF;欲赚比较基准90%以上是商品指数的共同基金;主要投资于通货膨胀保护债券的ETF或债券型基金;以及主要投资于自然资源类公司股票的ETF和共同基金。

若法律法规或监管机构允许,本基金在履行适当程序后,可以调整上述投资比例。

五、基金的投资策略

本基金采用将自上而下的资产配置与自下而上的个券选择相结合、构造被动的通胀跟踪组合与适度的主动投资以获取超额收益相结合的策略。

1.资产配置策略

自上而下的资产配置策略包括战略和战术两个层面。

"战略资产配置"策略是指本基金在对全球宏观经济周期、各国央行的货币政策、对中国商品的需求、房地产、消费、货币和财政政策等宏观趋势判断的基础上,判断通胀走势,确定对应的大类资产及配置的比例重心。

"战术资产配置"策略是指本基金在战略资产配置的基础上,结合对中短期通胀变化和市场情况等因素的判断,对大类资产的相对比重或仓位在一定范围内灵活地调整,降低投资组合的下行风险,以取得较高的超额收益。

2.各子类资产的投资策略

(1)通胀保护债券投资策略

通胀保护债券与量度通胀的居民消费指数(CPI)挂钩,意即当CPI上升时,其本金及派息会随通胀变动,在一定程度上可防止投资者的购买力被通胀蚕食。

(2)基金投资策略

本基金主要投资于与通货膨胀关系密切的各类资产,主要包括两大类:1)大宗商品类,包括贵金属、能源类、农产品和工业金属类等大宗商品相关基金和ETF;2)通胀保护债券类基金和ETF。

1)　通胀保护组合投资策略

本基金在分析中国通胀动因的基础上,结合统计模型选择与中国通货膨胀关系密切的国际大宗商品品种,然后根据相关性、流动性和交易成本等因素,选择对应的境外基金或ETF,通过投资组合优化构建与中国通胀相关性较高的通胀跟踪投资组合。

2)主动趋势投资

本基金以全球大宗商品相关ETF趋势投资策略作为收益来源的重要部分,通过多策略分散风险,从全球商品价格的变化趋势中获利。

3)风险管理策略

本基金根据基金资产投资组合的新兴市场和通胀相关行业或个股上,通过投资于这两类资产,本基金争取同时能达到防通胀和分享新兴市场国家高速增长收益的目的。

4)衍生品投资策略

本基金将根据对股票市场、债券市场的整体趋势及人民币币值变化趋势的研判,选择适当的时机使用衍生工具进行仓位管理和避险。

5)外汇管理

本基金将通过积极的外汇管理减少人民币升值对投资收益的侵蚀,管理人将根据对汇率前景的预测以及对中期帐回的需要,将货币资产在港币、美元、日元、澳元、欧元、美钞、加元和人民币等币种之间进行配置。

六、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:标普高盛商品类总收益指数(S&P GSCI Precious Metal Total Return Index)收益率×20%+标普高盛农产品总收益指数(S&P GSCI Agricultural Total Return Index)收益率×30%+标普高盛能源类总收益指数(S&P GSCI Energy Total Return Index)收益率×20%+巴克莱美国通胀保护债券指数(Barclays Capital U.S. Treasury Inflation Protected Securities (TIPS) Index (Series-L))收益率×30%,简称"通胀综合跟踪指标"。其中,前三个指数是标准·普尔公司编制发布的标准大宗商品分类指数,巴克莱美国通胀保护债券指数是境外共同基金最常用的抗通胀债券指数。

标普高盛商品分类指数由高盛公司于1991年编制发布,2007年2月由标准·普尔公司收购。目前该指数系列是国际市场上跟踪资产最最大的商品指数,具有较高的知名度和市场影响力,巴克莱美国通胀保护债券指数由巴克莱资本于1997年与美国通胀保护债券首次发行同年推出的债券指数,是国际市场上最常用和跟踪资产最最大的通胀保护债券指数,本基金选择的标普高盛商品分类指数和巴克莱美国通胀保护债券指数覆盖了国际市场上最主要的两类实际收益资产类别,其中,本基金所选择的贵金属、农产品和能源类三个分类指数覆盖了标普高盛大宗商品总指数中87.1%的资产,包含了16个品种,权重选择上更符合国内CPI的构成。本基金业绩比较基准选取的指数及其权重与本基金的投资范围和资产配置具有较好的一致性。

如法律法规发生变化,或基金变更投资范围,或市场中出现其他更具有代表性的、更适合用于本基金的、投资者认同度更高的业绩比较基准,或原指数供应商变更或停止原指数的编制及发布,在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

七、风险收益特征

本基金为基金中基金,主要投资范围为抗通胀相关主题的资产,本基金所指的抗通胀相关主题的资产包括抗通胀主题相关的基金和其他资产,抗通胀相关主题的其他资产主要指通胀挂钩债券和通胀相关的权益类资产等,本基金的收益和风险低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于中高风险/收益特征的开放式基金。

八、基金投资组合报告

博时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。

基金管理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2015年3月31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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	38,349,512.60	25.46
	其中:普通股	38,349,512.60	25.46
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	88,199,064.17	58.54
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,181,983.96	7.42
8	其他各项资产	12,922,419.22	8.58
9	合计	150,652,979.95	100.00

2.报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
香港	38,349,512.60	26.64
合计	38,349,512.60	26.64

3.报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
金融	14,769,310.14	10.26
信息科技	8,164,863.72	5.67
医疗保健	8,099,595.50	5.63
非必需消费品	4,831,749.00	3.36
工业	2,483,994.24	1.73
合计	38,349,512.60	26.64

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

4.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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	中国银河	6881 HK	香港证券交易所	中国香港	1,800,000	12,646,508.94	8.79
2	CHINA ANIMAL HEALTHCARE LTD	中国动物保健品	940 HK	香港证券交易所	中国香港	1,508,000	6,211,252.94	4.32
3	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	创维数码	751 HK	香港证券交易所	中国香港	1,000,000	4,831,749.00	3.36
4	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	中国民航信息网络	696 HK	香港证券交易所	中国香港	600-000	4-244-018.22	2.95
5	SINOCOM SOFTWARE GROUP LTD	中讯软件	299 HK	香港证券交易所	中国香港	3,000,000	3,920,845.50	2.72
6	CHINA MACHINERY ENGINEERIN-H	中国机械工程	1829 HK	香港证券交易所	中国香港	400-000	2-483-994.24	1.73
7	CHINA SMARTPAY GROUP HOLDING	中国支付通	8325 HK	香港证券交易所	中国香港	2,000,000	2,122,801.20	1.47
8	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	康哲药业	867 HK	香港证券交易所	中国香港	200,000	1,888,342.56	1.31

注:所用证券代码采用当地市场代码。

5.报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

9.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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	HANG SENG H-SHARE INDEX ETF	ETF	交易型开放式	Hang Seng Investment Management Ltd	12,819,976.65	8.91
2	SPDR BARCLAYS HIGH YIELD BD	ETF	交易型开放式	SSgA Funds Management Inc	12,044,854.20	8.37
3	IPATH BLOOMBERG AGRICULTURE	ETN	交易型开放式	Barclays Capital Inc	7,886,437.39	5.48
4	ETFS PHYSICAL PALLADIUM SHAR	ETF	交易型开放式	ETF Securities USA LLC	7-884-005.08	5.48
5	POWERSHARES DB BASE METALS F	ETF	交易型开放式	Deutsche Bank AG	7,449,260.16	5.18
6	POWERSHARES DB AGRICULTURE F	ETF	交易型开放式	Deutsche Bank AG	6,799,415.40	4.72
7	ETFS PLATINUM TRUST	ETF	交易型开放式	ETF Securities USA LLC	6,120,026.66	4.25
8	MARKET VECTORS EMERGING MARK	ETF	交易型开放式	Van Eck Associates Corp	5,190,404.69	3.61
9	SPDR S&P 500 ETF TRUST	ETF	交易型开放式	SSgA Funds Management Inc	4,437,770.21	3.08
10	ISHARES SILVER TRUST	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	3,913,809.84	2.72

10.投资组合报告附注

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

10.2 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。

10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	12-427.784.06
3	应收股利	36,018.48
4	应收利息	1,053.98
5	应收申购款	457,562.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12.922.419.22

10.4 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。

10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

10.6 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。

九、基金的业绩

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

自基金合同生效开始,基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2011年4月25日至2011年12月31日	-18.60%	0.63%	-9.53%	0.97%	-9.07%	-0.34%
2012年1月1日至2012年12月31日	-3.19%	0.56%	5.66%	0.70%	-8.85%	-0.14%
2013年1月1日至2013年12月31日	-19.92%	0.84%	-15.70%	0.57%	-4.22%	0.27%
2014年1月1日至2014年12月31日	0.79%	0.55%	-12.84%	0.54%	13.63%	0.01%
2015年1月1日至2015年3月31日	-1.26%	0.51%	-3.49%	0.81%	2.23%	-0.30%
2011年4月25日至2015年3月31日	-37.20%	0.65%	-32.21%	0.70%	-4.99%	-0.05%

十、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:博时基金管理有限公司

住所:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层

办公地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层

法定代表人:洪小源

成立时间:1998年7月13日

注册资本:2.5亿元人民币

存续期间:持续经营

联系人:韩强

联系电话:(0755)83169999

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

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

公司下设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、市场销售总部以及发现策略部、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管理资产的权益投资管理及相关工作,权益投资总部下设投顾投资部(含各投资风格小组),研究部、股票投资部负责进行投资选择和组合管理,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,固定收益总部下设规金管理部、公募基金部、专户部、国际和联合部,负责为公司管理的收益资产的相关投资决策、市场研究业务及产品设计等工作,市场销售总部下设机构与零售网点业务线和销售服务部,机构业务线含战略客户部、机构一上海、机构一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理资金业以及该区域机构客户的销售与服务工作,机构一上海和机构一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,零售业务线含零售一东京、零售一南京三大区域,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资会议决策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产品的投资管理及相关工作,产品规划部负责产品设计、新产品报备、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,指动公司相关业务在互联网平台的整合与创新,董事长办公室有门负责股东会、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、与公司治理及发展战略等相关的信息披露管理、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、基金宣传、产品设计等实施合规性监督,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,分别负责对北京、沪、沈阳、郑州和成都人员日常行政管理和对北京、沪、沈阳和郑州地区业务人员给予协助、此外,还设有全资子公司博时资本管理有限公司,以及境外子公司博时基金(国际)有限公司。

截止到2014年12月31日,公司总人数为389人,其中研究员和基金经理超过94%拥有硕士及以上学位。

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

(二)主要人员情况

1、　基金管理人董事会成员

洪小源先生,双硕士,董事长,1988年以来曾就职于国家经济体制改革委员会综合规划司,后历任深圳龙岗实业股份有限公司总经理,招商局蛇口工业区有限公司总经理助理,招商局地产控股股份有限公司总经理,招商局科技集团有限公司总经理,招商局蛇口工业区有限公司副总经理;曾任中诚信托有限责任公司董事,现任上海国有资本投资有限公司董事,招商局仁和人寿保险股份有限公司董事长,招商局保险有限公司董事长,招商局中国投资管理有限公司董事长,现任招商局集团有限公司总经理助理,招商局金融集团有限公司总经理,招商局中国基金有限公司董事长;招商证券股份有限公司董事会风险管理委员会主任,招商银行股份有限公司董事会风险及资本管理委员会主任,2014年11月起,任博时基金管理有限公司董事长。

袁曰国先生,博士后,副董事长,1993年起历任山东省投资银行部副总经理,副总经理,泰安营业部副总经理,中经信投资公司总经理助理,中经证券有限公司筹备组组长,永汇信用担保有限公司董事长,总经理,中国外汇投资产管理公司投资事业部总经理助理,副总经理,中国长城资产管理公司投资银行事业部副总经理,总经理,2011年7月起,任博时基金管理有限公司第五届董事会副董事,2013年8月起,任博时基金管理有限公司第五届董事会副董事,2014年11月起,任博时基金管理有限公司第六届董事会副董事。

郭润涛先生,硕士,工程师,董事,1992年5月至1993年4月任职于深圳山星电子有限公司,1993年起,历任招商银行总代电脑部信息中心副经理,招商证券股份有限公司电脑部副经理、经理、电脑中心总经理,技术总监兼信息技术中心总经理;2004年1月至2004年10月,被中国证监会借调至南方证券行政接管组任接管组成员;2005年12月起任招商证券股份有限公司副总裁,现分管经纪业务、资产管理业务、信息技术中心,兼任招商期货有限公司董事长、中国证券业协会证券经纪专业委员会副主任委员,2014年11月起,任博时基金管理有限公司第六届董事会董事。

吴杨东先生,博士,北京大学光华管理学院EMBA,董事,2002年进入联合证券股份有限公司,历任国际业务部副总经理,招商证券(香港)公司总经理兼国际业务部董事,总裁办公室总经理,董事总经理,公司总裁助理,2013年5月加入博时基金管理有限公司,曾任公司总经理,现任公司董事,博时基金(国际)有限公司董事会副主席兼总裁,博时资本管理有限公司董事长兼总经理,2013年7月起,任博时基金管理有限公司第五届、第六届董事会董事。

王金宝先生,硕士,董事,1988年7月至1995年4月在上海同济大学数学系工作,任教师,1995年4月进入招商证券,先后任上海澳门路营业部总经理,上海城区总部副总经理(主持工作),投资部总经理,投资部总经理兼固定收益部总经理,股票销售交易部总经理(现更名为机构业务总部)、机构业务兼事总经理,2002年10月至2008年9月,任博时基金管理有限公司第二届、第三届监事会监事,2008年7月起,任博时基金管理有限公司第四届至第六届董事会董事。

杨林峰先生,硕士,高级经济师,董事,1988年8月就职于国家纺织工业部,1992年7月至2006年6月任职于中国华源集团有限公司,先后任华源发展股份有限公司(上海证交所上市公司)董秘、副总经理,常务副总经理等职,2006年7月就职于上海市国资委直属上海大盛资产有限公司,任战略投资部副总经理,2007年10月至今,出任上海盛业股权投资基金有限公司执行董事、总经理,2011年7月至2013年8月,任博时基金管理有限公司第五届监事会监事,2013年8月起,任博时基金管理有限公司第五届、第六届董事会董事。

何追龙先生,硕士,助立董事,1971年起,先后在北京西城区半导体器件厂、北京东城区电子仪器一厂、中共北京市委党校、社科院美国研究所、加州大学伯克利分校、布鲁津斯学会、标准国际投资管理公司工作,1997年9月至今任瑞银投资银行副主席,2008年1月,何追龙先生建立了资助、支持中国经济、社会与国际关系领域中长期问题研究的非营利公益组织"博源基金会",并担任该基金会的董事,2012年7月起,任博时基金管理有限公司第五届、第六届董事会独立董事。

李南峰先生,学士,独立董事,1969年起先后在中国人民解放军酒泉卫星基地、四川大学经济系、中国人民银行、深圳国际信托投资公司、华润深国投信托有限公司工作,历任中国人民银行总行金融研究所研究院、深圳特区人行办公室主任、深圳国际信托投资公司副总经理、总经理、董事长、党委书记,华润深国投信托有限公司总经理、副董事长,1994年至2008年曾兼任国信证券股份有限公司董事、董事长,2010年退休,2013年8月起,任博时基金管理有限公司第五届、第六届董事会独立董事。

顾立基先生,硕士,独立董事,1968年至1978年就职于上海印染机械修配厂,任共青团总支书记;1983年起,先后任招商局蛇口工业区管理委员会办公室秘书、主任;招商局蛇口工业区免税品有限公司董事总经理;中国国际海运集装箱股份有限公司董事副总经理、总经理;招商局蛇口工业区有限公司副总经理,国际招商局贸易投资有限公司董事副总经理;蛇口招商港务股份有限公司董事总经理;招商局蛇口工业区有限公司董事总经理;香港海通有限公司董事总经理;招商局科技集团有限公司董事总经理,招商局蛇口工业区有限公司副总经理,2008年退休,2008年2月至今,任清华大学深圳研究生院兼职教授;2008年11月至2010年10月,兼任招商局科技集团有限公司代行董事;2009年6月至今,兼任中国平安保险(集团)股份有限公司外部监事、监事会主席;2010年3月至今,兼任招商局集团有限公司外部董事;2013年5月至今,兼任中国人寿保险有限公司(DCNL)董事;2013年6月至今,兼任深圳市昌红科技股份有限公司独立董事;2014年12月至今,兼任深圳市创鑫激光股份有限公司董事,2014年11月起,任博时基金管理有限公司第六届董事会独立董事。

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

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

林琦先生,硕士,监事,1998年起历任南天信息系统集成公司任软件工程师、北京万象力霸电子科技公司任技术经理、博时基金管理有限公司MIS系统分析员、东方基金管理有限公司总经理助理、博时基金管理有限公司信息技术部副总经理,现任博时基金管理有限公司信息技术部总经理,2010年4月起,任博时基金管理有限公司第四至六届监事会监事。

聂卫平先生,硕士,监事,1996年起先后在山东国际信托投资公司、大鹏证券公司、北京证券公司、博时基金管理有限公司工作,现任博时基金管理有限公司交易部总经理,2013年8月起,任博时基金管理有限公司第五至六届监事会监事。

十一、基金的费用与税收

一、与基金运作有关的费用

(一)基金费用的种类

1.基金管理人的管理费;

2.基金托管人的托管费;

3.基金的证券交易费用;按资其它基金的费用及在境外市场的开户、交易、清算、登记等各项费用;

4.基金合同生效以后的信息披露费用;

5.基金份额持有人大会费用;

6.基金合同生效以后的会计师费和律师费;

7.基金的资金汇划费用;

8.基金依照有关法律法规应当缴纳的,购买或处置证券有关的任何税收、证费、关税、印花税、交易及其他税收及预提税(以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用)(简称"税收");

9.代表基金投票的费用;

10.更换基金管理人、更换基金托管人及基金资产由原基金托管人转移至新基金托管人以及由于境外托管人更换导致基金资产转移所引起的费用;

11.与基金有关的诉讼、追索费用;

12.基金进行外汇兑换交易的相关费用;

13.按照国家有关规定可以列入的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金资产总值中扣除。

(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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.60%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.60%年费率计提,计算方法如下:

H=E×1.60%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2.基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费(如基金托管人委托境外托管人,包括向其支付的相应服务费)按基金资产净值的0.30%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提,计算方法如下:

H=E×0.30%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3.本条第(一)款第3至第13项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

二、与基金销售有关的费用

1.申购费用

申购金额(M)	申购费率
M<50万元	1.50%
50万元≤M<100万元	1.00%
100万元≤M<500万元	0.60%
M≥500万元	收取固定费用1000元

2.赎回费用

持有基金时间(Y)	赎回费率
Y<1年	0.50%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0

基金管理人可根据有关法律规定和市场情况,调整申购金额、赎回份额和账户最低持有余额的数量限制,基金管理人必须最迟在调整前2日在至少一种指定媒体上公告。

3.转换费用

基金转换费用由转出基金赎回费和申购补差两部分构成,其中:申购费补差具体收取情况,视每次转换时的两只基金的申购费率的差异情况而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

三、不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用,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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

四、基金费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体公告。

五、税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规和境外市场的规定履行纳税义务。

十二、基金托管人

(一)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:人民币贰仟柒佰玖拾肆亿捌仟柒拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

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:王东民

客服电话:95566

传真:(010)66594942

(二)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。

(三)证券投资基金托管情况

截至2015年3月31日,中国银行已托管328只证券投资基金,其中境内基金303只、QDII基金25只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等各种类型的基金,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。

(四)托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行金面风险控制工作的组成部分,要求中国银行风险控制理念,坚持"规范运作、稳健经营"的原则,中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节,包括风险识别、风险评估、工作程序设计与制度建设、风险检视、工作程序与制度的执行、工作程序与制度的执行、工作程序与制度的执行、工作程序与制度执行情况的内部监督、稽核以及风险控制工作的信评价。

2007年起,中国银行连续聘请外部会计计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作,先后获得基于"SAS70"、"AAF01/06"、"ISAE3402"和"SSAE16"等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告,2013年,中国银行同时获得了基于"ISAE3402"和"SSAE16"双准则的内部控制审计报告,中国银行托管业务内控制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

(五)托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》的相关规定,基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同的规定,应当拒绝执行,及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

十三、境外托管人

(一)中银香港概况

名称:[中国银行(香港)有限公司]

住所:[香港花园道1号中银大厦]

办公地址:[香港花园道1号中银大厦]

法定代表人:[和广北总裁]

成立时间:[1964年10月16日]

组织形式:[股份有限公司]

存续期间:[持续经营]

联系人:[黄晚仪　副总经理　托管业务主管]

联系电话:[852-3982-3753]

中国银行(香港)有限公司("中银香港")早于1964年成立,并在2001年10月1日正式重组为中国银行(香港)有限公司,是一家在香港注册的持牌银行,其控股公司—中银香港(控股)有限公司("中银香港(控股)")—则于2001年2月在香港注册成立,并于2002年7月25日开始在香港联合交易所主板上市,2002年12月2日被纳入为恒生指数成分股。中银香港目前主要受香港金管局、证监会以及联交所等机构的监管。

截至2013年12月31日,中银香港的总资产为2,541.5亿美元,资本总额为190.0亿美元,其中实收资本为55.2亿美元,至于资本充足比率更达16.8%,中银香港的财务实力及双A级信用评级,可以赢或不久大型全球托管银行,中银香港最新信评如下(截至2013年12月31日):

| | 穆迪投资服务 | 标准普尔 | 惠誉国际评级