

(上接B70版)

(5) 信息技术系统风险管理。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责,机房24小时值班并设置门禁管理、电脑密码授权权限管理、业务网络双公网、与安全业务网双分离制度,与外部业务机构实行防火墙保护等,保证信息技术系统的安全。

(6) 人力资源风险管理。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制,加强人力资源管理和建立人才梯队队伍及人才储备机制,有效的进行人力资源风险管理。

(七) 基金托管人对基金管理人运用基金投资监督的方法和程序
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》等有关证券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、基金投资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、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的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律、法规规定的,应及时以书面形式通知基金管理人进行整改,整改的时限应符合法律法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式向基金托管人作出回应对应改正。在规定时间内,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。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人未按指令投资(基金法)、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定,应当拒绝执行,立即通知基金管理人限期改正,如基金管理人未在通知期限内纠正的,基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人有权配合和协助基金托管人依据法律法规基金合同和托管协议对基金业务执行核查。对基金管理人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并解释,或就基金托管人的意见进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、基金合同和托管协议的要求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和提供相关资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为,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、相关服务机构

(一) 基金份额销售机构

1. 博时基金管理有限公司北京分公司及北京直销中心

名称: 博时基金管理有限公司北京分公司及北京直销中心
地址: 北京建国门内大街18号恒信中心18层2121
电话: 010-65181055
传真: 010-65181032
联系人: 高源
网址: 951058(电话语音)

2. 博时基金管理有限公司上海分公司

名称: 博时基金管理有限公司上海分公司
地址: 上海市黄浦区四川中路28号久事大厦25层
电话: 021-33028999
传真: 021-63326180
联系人: 郝明达

3. 博时基金管理有限公司总公司

名称: 博时基金管理有限公司总公司
地址: 深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层
电话: 0755-83169999
传真: 0755-83199480
联系人: 魏程斌

(二) 代销机构

(1) 招商银行银行股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区深南大道7088号
办公地址: 深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人: 李健刚
联系人: 李承刚
电话: 010-54559998
传真: 010-61253808
客户服务电话: 400-818-1888
网址: http://www.cmbchina.com/

(2) 上海天天基金销售有限公司

注册地址: 上海市徐汇区龙汇路190号2号楼2层
办公地址: 上海市徐汇区龙汇路195号3楼909室
法定代表人: 其实
联系人: 董文婷
电话: 021-54559998
传真: 010-81253808
客户服务电话: 400-818-1888
网址: http://www.1234567.com.cn

(3) 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4层4609-109F
办公地址: 北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人: 赵学军
联系人: 李永刚
电话: 010-85979570
传真: 010-65215433
客户服务电话: 400-601-8880
网址: www.lawsoncm.com

(4) 中信证券股份有限公司

注册地址: 北京市朝阳区麦子店西路10号
办公地址: 北京市朝阳区麦子店西路10号
法定代表人: 王东明
联系人: 陈忠
电话: 010-64888888
传真: 010-84465580
客户服务电话: 010-84465580
网址: http://www.citic.com

四、基金名称

博时新趋势灵活配置混合型证券投资基金

五、基金类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金通过多种投资策略的有机结合,在有效控制风险的前提下,力争为基金份额持有人获取长期持续稳定的投资回报。

七、投资方向

本基金的投资对象是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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具,以及债券等固定收益类金融工具(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、永续债、可交换公司债券、可转债、资产支持证券等)、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等)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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

八、投资策略

本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析互相补充的方法,在股票、债券和现金等资产大类之间进行相对稳定的资产配置,强调通过自下而上的宏观分析对自上而下的市场趋势分析有结合进行前瞻性的决策。

(一) 资产配置策略

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的60%-95%;中小企业私募债占基金资产净值的比例不超过20%;每个交易日终扣除股指期货合约占用的保证金后,本基金保留的现金或到期在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;投资债券类资产占基金资产净值的0-3%。

(二) 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、可转债策略等。

(三) 股票投资策略

本基金通过预期收益率曲线的形状和变化趋势,对各类型债券进行久期调整。具体策略又分为预期收益率曲线的期限策略和基于收益率曲线变动的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

(四) 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。

(五) 可转债投资策略

本基金利用宏观经济变化和上市公司的盈利变化,判断市场的变化趋势,选择不同的行业,再根据可转债的特性选择各行业不同的转债品种。本基金采用可转换债券的债券底价和到期收益率来判断转债的投资,增强本基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,优先选择转股性的品种,获取超额收益。

6. 中小企业私募债券投资策略

针对中小企业私募债券,本基金将以持有到期,获得本金和利息收入为主要投资策略,同时,密切关注债券的信用风险变化,力争在控制风险的前提下,获得较高收益。

11.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。11.3 其他资产构成

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	49,862,519.50	2.72
2	其中:股票	49,862,519.50	27.40
3	固定收益投资	1,334,975,024.20	73.40
4	其中:债券	1,334,975,024.20	73.40
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他	47,616,710.40	2.61
9	待摊费用	-	-
10	其他	-	-
11	合计	1,818,230,181.17	100.00

12. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	8,229,400.00	0.46
B	采矿业	-	-
C	制造业	31,824,097.11	1.79
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,526,224.48	0.09
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	7,882,350.00	0.44
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,081	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生健康业	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	综合	49,642,081.59	2.79
S	合计	49,642,081.59	2.79

2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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	000568	泸州老窖	400,000	9,560,000.00	0.54
2	002582	好想你	300,000	5,910,000.00	0.35
3	002152	广汇股份	500,000	4,828,000.00	0.47
4	600257	大冶特钢	715,000	4,339,000.00	0.46
5	600676	中国铁建	635,000	4,177,350.00	0.24
6	600262	国阳新能	80,000	3,498,000.00	0.21
7	600662	泰达股份	900,000	3,485,000.00	0.21
8	300525	巴安水务	100,000	1,490,000.00	0.08
9	002729	华神集团	3,081	138,440.76	0.00
10	603861	白云山	4,016	96,735.40	0.00

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	国债债券	46,243,110.00	2.62
2	金融债券	1,284,935,000.00	72.63
3	企业债券	1,284,935,000.00	72.42
4	企业中期票据	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换债券(可交换债)	3,026,914.20	0.21
8	国债回购	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,334,975,024.20	73.40

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	150420	15国债20	2,300,000	2,300,000.00	0.13
2	130425	13国债25	1,600,000	1,679,800.00	0.09
3	150009	15国开09	1,500,000	1,531,950,000.00	84.67
4	150207	15国开07	1,200,000	1,234,400,000.00	6.96
5	150418	15国债18	1,200,000	1,226,200,000.00	6.89

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11. 投资组合报告附注

1. 报告期内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本基金投资的前十名证券的发行主体受到公开谴责和处罚。

2. 基金管理人运用基金投资股指期货的投资情况

本基金本报告期末未持有股指期货。

3. 基金管理人运用基金投资国债期货的投资情况

本基金本报告期末未持有国债期货。

4. 基金投资中小企业私募债券的情况

本基金本报告期末未持有中小企业私募债券。

5. 基金投资资产支持证券的情况

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6. 基金使用股指期货的情况

本基金本报告期末未持有股指期货。

7. 基金使用国债期货的情况

本基金本报告期末未持有国债期货。

8. 基金使用权证投资的情况

本基金本报告期末未持有权证。

9. 基金使用股指期货的情况

本基金本报告期末未持有股指期货。

10. 基金使用国债期货的情况

本基金本报告期末未持有国债期货。

11. 基金使用权证投资的情况

本基金本报告期末未持有权证。

12. 基金使用股指期货的情况

本基金本报告期末未持有股指期货。

13. 基金使用国债期货的情况

本基金本报告期末未持有国债期货。

14. 基金使用权证投资的情况

本基金本报告期末未持有权证。

15. 基金使用股指期货的情况

本基金本报告期末未持有股指期货。

16. 基金使用国债期货的情况

本基金本报告期末未持有国债期货。

17. 基金使用权证投资的情况

本基金本报告期末未持有权证。

18. 基金使用股指期货的情况

本基金本报告期末未持有股指期货。

19. 基金使用国债期货的情况

本基金本报告期末未持有国债期货。

20. 基金使用权证投资的情况

本基金本报告期末未持有权证。

21. 基金使用股指期货的情况

本基金本报告期末未持有股指期货。

22. 基金使用国债期货的情况

本基金本报告期末未持有国债期货。

23. 基金使用权证投资的情况

本基金本报告期末未持有权证。

24. 基金使用股指期货的情况

本基金本报告期末未持有股指期货。

25. 基金使用国债期货的情况

本基金本报告期末未持有国债期货。

26. 基金使用权证投资的情况

本基金本报告期末未持有权证。

27. 基金使用股指期货的情况

本基金本报告期末未持有股指期货。

28. 基金使用国债期货的情况

本基金本报告期末未持有国债期货。

29. 基金使用权证投资的情况

本基金本报告期末未持有权证。

30. 基金使用股指期货的情况

本基金本报告期末未持有股指期货。

31. 基金使用国债期货的情况

本基金本报告期末未持有国债期货。

32. 基金使用权证投资的情况

本基金本报告期末未持有权证。

33. 基金使用股指期货的情况

本基金本报告期末未持有股指期货。

34. 基金使用国债期货的情况

本基金本报告期末未持有国债期货。

35. 基金使用权证投资的情况

本基金本报告期末未持有权证。

36. 基金使用股指期货的情况

本基金本报告期末未持有股指期货。

37. 基金使用国债期货的情况

本基金本报告期末未持有国债期货。

38. 基金使用权证投资的情况

本基金本报告期末未持有权证。

39. 基金使用股指期货的情况

本基金本报告期末未持有股指期货。

40. 基金使用国债期货的情况

本基金本报告期末未持有国债期货。

41. 基金使用权证投资的情况

本基金本报告期末未持有权证。

42. 基金使用股指期货的情况

本基金本报告期末未持有股指期货。

43. 基金使用国债期货的情况

本基金本报告期末未持有国债期货。

44. 基金使用权证投资的情况

本基金本报告期末未持有权证。

45. 基金使用股指期货的情况

本基金本报告期末未持有股指期货。

46. 基金使用国债期货的情况

本基金本报告期末未持有国债期货。

47. 基金使用权证投资的情况