博时上证50交易型开放式证券投资基金联接基金更新招募说明书摘要

2018年第1号

博时上证50交易型开放式证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（关于核准博时上证50交易型开放式证券投资基金联接基金募集的批复）（证监许可[2015]509号，核准日期2015年3月31日）准予注册，进行募集。本基金的基金合同于2015年5月27日正式生效。本基金为契约型开放式基金。

【重要提示】

本基金经中国证监会2015年3月31日证监许可[2015]509号文准予注册，进行募集。

本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价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场，基金资产净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括但不限于：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的操作风险，本基金及目标ETF基金的特定风险等。本基金为ETF联接基金，通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。同时，本基金为被动式投资的股票型指数基金，最终上证50指数，其预期风险与预期收益高于债券型基金、混合型基金、货币市场基金，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金对博时上证50交易型开放式指数证券投资基金的投资比例不低于本基金资产净值的90%，投资标的单一且过分集中有可能会给本基金带来风险。投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

投资有风险，投资人认购（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。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本招募说明书更新所载内容截止日为2017年11月27日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年9月30日。（财务数据未经审计）

一 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：博时基金管理有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层

法定代表人：张光华

成立时间：1998年7月13日

注册资本：25亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：韩强

联系电话：（0755）8316 9999

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26号文批准设立。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份49%；中国长城资产管理公司，持有股份25%；天津港（集团）有限公司，持有股份6%；上海汇华实业有限公司，持有股份12%；上海益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25亿元人民币。

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

公司下设两大总部和二十八个直属部门，分别是：权益投资总部、固定收益总部以及宏观策略部、交易部、指数与量化投资部、特定资产管理部、多元资产管理部、年金投资部、产品规划部、营销服务部、客户服务中心、市场部、养老金业务中心、战略客户部、机构一上海、机构一南方、券商业务部、零售一北京、零售一上海、零售一南方、央企业务部、互联网金融部、董事办公室、办公室、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、风险管理部和监察法律部。

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

市场部负责公司市场和销售管理、销售组织、目标和费用管理、销售督导与营销培训管理，公司零售渠道银行总行管理与维护、推动金融同业业务合作与拓展、国际业务合作与协作等工作。战略客户部负责机构业务、券商业务方地区由国资委和财政部直接管辖企业以及省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、华南地区以及辖区内的机构客户销售与服务工作。养老金业务中心负责公司社保基金、企业年金、基本养老金及职业年金的客户拓展、销售与服务。养老金研究室与政策咨询、养老金销售支持与中台运作协调、相关信息服务等工作。券商业务部负责券商渠道的开拓和销售服务。零售一北京、零售一上海、零售一南方负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。央企业务部负责拓展国资委、财政部等机构客户、重要中央企业及其所属子公司等客户的拓展、合作业务落地与服务等工作。营销服务部负责营销策划、销售支持、品牌传播、对外媒体宣传等工作。

宏观策略部负责为投委会审定资产配置计划提供宏观研究和策略研究支持。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。指数与量化投资部负责公司各类指数与量化投资产品的研究和投资管理工作。特定资产管理部负责公司权益类特定资产专户的权益类社会保险资组合的投资管理及相关工作。多元资产管理部负责公司的基本养老保险基金投资管理、公司自有资产的研究和投资管理工作。年金投资部负责公司年管理企业年金等年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、推动市场和客户信息的收集、分析、处理以及为投资、营销、客户服务等业务部门的服务和咨询工作。

董事会办公室和（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、高管人员的管理、信息披露、投资者关系管理、公司形象宣传、公司文化建设、公司治理及其他日常事务等工作。办公室负责公司的行政后勤支持、会议及文件管理、外事活动管理、档案管理及下属工会工作等。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技术系统开发、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控制及时监督与控制。监察法律部负责公司法律、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，分别负责对辽宁、沈阳、郑州和成都四大区内的机构客户进行销售和服务。此外，还设有全资子公司博时资本管理有限公司，以及境外子公司博时基金（国际）有限公司。

截止到2017年9月30日，公司总人数为506人，其中研究员和基金经理超过86%拥有硕士及以上学位。

公司设有一位董事长、一位总经理、两位副总经理、两位监察制度、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。

董事长：张光华，1957年生，中共党员，西南财经大学经济学博士，高级经济师。1986年至1992年，任国家外汇管理局政研室副主任，计划处处长；1992年至2002年，任中国人民银行海南省分行行长助理、中国人民银行海南省分行行长兼国家外汇管理局海南省分局副局长；中国人民银行广州分行副行长；广东发展银行行长；2007年4月至2015年7月，历任招商银行执行董事、副行长、副董事长，期间兼任永隆银行副董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长、招商基金管理有限公司董事长、招商证券股份有限公司董事长、招银金融有限公司董事长、招银金融有限公司董事长；2015年7月起，任博时基金管理有限公司第六届董事会董事长。

汪洋国先生，教授，中共党员，海外大学经济学博士，北京大学金融学硕士暨北京大学EMBA。1986—1990年就读于北京师范大学信息与情报学系，获学士学位；1994—1997年就读于中国政法大学研究生院，获法学硕士学位；2003—2006年，就读于南开大学国际经济研究所，获国际金融博士学位。历任中国证监会办公厅、党办副主任兼新闻办（网信办）主任；中国证监会办公厅副巡视员；中国证监会深圳专员办处长、副专员；中国证监会期货监管部副处长、处长；中国农业工程研究设计院博悦证书室，2015年1月至7月，任招商局金融集团副总经理，博时基金管理有限公司董事副书记；2015年7月起，任博时基金管理有限公司总经理、第六届董事会董事。

彭益女士，分别于 1994年 7 月及 2010 年 7 月获得西南财经大学企业管理专业经济学学士学位，以及北京大学金融学专业经济学硕士学位。曾在不同证券和金融类公司担任管理或行政职位，拥有相关管理和从业经验。于 2002 年 5 月至 2003 年 10 月兼任友联资产管理公司执行董事，于 2002 年 5 月加入招商局金融集团有限公司，历任综合管理部副总经理、审计稽核部总经理、中国业务部总经理、证券部总经理、总经理助理。自 2011 年 6 月起担任长城证券股份有限公司董事；自 2015 年 3 月起担任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司董事；自2016年 4 月起担任招商局金融集团有限公司副总经理。

王金年先生，1964年生，硕士，1981年至1985年在南京大学数学系学习，获学士学位。1985年至1988年在复旦大学数理统计系学习，获硕士学位。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，1996年5月任招商证券上海闸门路营业部总经理；2001年9月任招商证券上海地区总部副总经理（主持工作）；2002年10月任招商证券投资部总经理；2006年1月任招商证券投资部总经理兼固定收益部总经理；2006年8月任招商证券投资部负责人兼固定收益部总经理；2008年4月任招商证券机构业务部总经理；2009年4月任招商证券机构业务部总经理兼固定收益部总经理；2012年4月任招商证券投资部负责人兼机构业务部总经理；2012年9月任招商证券投资部负责人兼机构业务部总经理（现更名为机构业务总部）；2017年8月任招商证券机构业务总部总经理兼任机构业务一部总经理，2002年10月至2006年7月，任博时基金管理有限公司副总经理，第三届董事会监事；2006年7月起，任博时基金管理有限公司董事会秘书。

陈克庆先生，北京大学工商管理硕士，2001年起历任世纪证券投资银行北京总部副总经理，国信证券投行业务部副总经理，华西证券投行业务部总经理兼董事总经理，2014年加入中国民族资产管理公司，现任投资投行事业部副总经理，2016年1月起，任博时基金管理有限公司第六届董事会董事。

张鹏先生，1972年生，学士，2000年毕业于英国威斯敏斯特大学，获得数学学士学位和经济学学士学位。2000年起，任职于瑞士信贷（CSFB）组约办公室并加入企业并购部门担任经理，负责全球电讯及消费零售行业的并购项目；2005年，加入摩根大通（JP Morgan）香港办公室担任副总裁，负责大中华区的企业并购项目；2008年，加入著名基金公司德伦集团（DE Shaw& Co.）之大中华区私募股权投资部门担任执行董事，2013年至今，加入上海合利股权投资基金管理有限公司担任董事及上海汇华实业有限公司投资总监，并负责股权投资项目管理。

顾立基先生，1948年生，硕士，1982年毕业于清华大学，获学士学位；1996年毕业于中国科技大学，获工学硕士学位。1968年至1978年就职于上海印染机械修配厂，任其省团总支书记；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总经理；招商局蛇口工业区有限公司副总经理；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，2008年2月至今，任清华大学深圳研究生院兼职教授；2009年6月至今，兼任中国平安保险（集团）股份有限公司外部监事，监事会主席；2011年3月至今，兼任港电集团有限公司外部董事；2013年5月至2014年5月，兼任德华安顿人寿保险有限公司（RGNL）董事；2013年6月至今，兼任深圳市自红科技股份有限公司独立董事。2014年11月起，任博时基金管理有限公司第六届董事会独立董事。

姜立军先生，1965年生，会计师，工商管理硕士（MBA），1974年12月参加工作，历任中国远洋运输总公司财务处科员、中国-坦桑尼亚联合海运服务公司财务部经理、日本中铁海运服务公司财务部经理、中远（美国）公司财务部经理、香港益丰船务公司财务部经理、香港-俄罗斯船务公司（香港上市公司）副总经理、中远太平洋有限公司（香港上市公司）副总经理、中远日本公司财务部长和管业副本部长、中远集装箱运输有限公司副总会计师等职。2002.8—2008.7，任中远航运股份有限公司（A股上市公司）首席执行官、董事。2008.8—2011.12，任中远投资（新加坡）有限公司（新加坡上市公司）总裁、董事会副主席、中远控股（新加坡）有限公司总裁；并任新加坡中资企业协会会长。2011.11—2015.12，任中国远洋控股股份有限公司执行董事（A+H上市公司）执行董事。2013.8—2015.12，兼任中国上市公司协会副监事长、天津上市公司协会副会长；2014.9—2015.12，兼任中国上市公司协会监事会专业委员会副主任委员。

赵凯冰先生，1956年生，教授级高级工程师，国际金融专业经济学硕士研究生。历任葛洲坝水力发电工厂作助理工程师、工程师、高级工程师、葛洲坝二工地厂厂长兼书记；1989.10任福州电厂副厂长兼书记；上海江东500万伏超高压直流输电换流站书记兼站长，主持参加了我国第一条亚洲最大的直流输电工程的建设并荣获国家试和运行；1991.10—1995.12任厂办公室主任兼外事办公室主任；1995.12—1999.12,任华能南方开发公司党组书记、总经理，兼任中国华能集团董事、深圳南山热电股份有限公司（上市公司代码000037）副董事长、长城证券有限责任公司副董事长，深圳华能电讯有限公司董事长；2000年1月至2004年1月，任华能能源公司表决权授权委托等方的法定代表人、董事、总经理、华能国际电力开发公司副总经理、长城证券有限责任公司副董事长、董事；2004.07—2009.03，任华能房地产开发公司党组书记、总经理；2009.12—2016.8，任景顺长城基金管理有限公司董事、景顺长城资产管理（深圳）公司董事长；2016.8—至今，任阳光资产管理股份有限公司副董事长；兼任西南证券、百隆东方、威华股份独立董事。

2、基金管理人董事会成员

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

陈良生先生，中央党校经济学硕士。1980年至2000年就职于中国农业银行巢湖市支行及安徽省分行。2000年起就职于中国长城资产管理公司，历任合肥办事处综合管理部部长、福州办事处党委委员、总经理、福建省分公司党委书记、总经理，2017年4月至今任中国长城资产管理股份有限公司机构协同部专职董监事，2017年6月起任博时基金管理有限公司监事。

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

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

黄建斌先生，工商管理硕士。1995年起先后在广发证券有限公司、广发基金管理有限责任公司投资管理部、博时基金管理有限公司基金管理部工作。2006年起加入博时基金管理公司，历任固定收益部基金经理、博时平衡配置混合型基金基金经理、固定收益部副总经理、社保组合投资经理、固定收益部总经理。现任公司总经理助理兼固定收益总部董事总经理、年金投资部总经理、社保组合投资经理、高级投资经理、兼任博时资本管理有限公司董事。2016年3月18日至今担任博时基金管理有限公司监事会员工监事。

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

3、高级管理人员

张光华先生，简历同上。

江向阳先生，简历同上。

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

董良泓先生，CFA，MBA，副总经理。1993年起先后在中国技术进出口总公司、中技上海投资公司、融通基金管理有限公司、长城基金管理有限公司从事投资管理工作。2006年2月加入博时基金管理有限公司，历任社保投资基金经理、特定资产投资投资经理、研究部总经理兼特定资产投资总监、社保投资基金经理、特定资产管理部总经理、博时资本管理有限公司董事。现任公司副总经理兼高级投资经理、社保组合投资经理，兼任博时基金（国际）有限公司董事。

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

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

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

4、基金基金经理

赵云阳先生，硕士。2003年至2010年在晨星中国研究中心工作。2010年加入博时基金管理有限公司，历任量化分析师、基金经理助理、博时特许价值混合型证券投资基金（2013年9月13日至2015年2月9日）、博时招财一号保本基金（2015年5月4日至2016年5月30日）、博时中证海企大数据100基金（2015年5月4日至2016年5月30日）、博时沪深300指数基金（2015年5月7日至2016年5月30日）基金经理。现任博时深证基本面200ETF基金兼博时深证基本面200ETF联接基金（2012年11月13日至今）、上证企债30ETF基金（2013年7月11日至今）、博时证券保险指数分级基金（2015年5月19日至今）、博时黄金ETF基金（2015年10月8日至今）、博时上证50ETF基金（2015年10月8日至今）、博时上证50ETF联接基金（2015年10月8日至今）、博时银行分级基金(2015年10月8日至今)、博时黄金ETF联接基金（2016年5月27日至今）的基金经理。

汪洋先生，硕士，2006年起先后在华泰联合证券、华泰柏瑞基金、汇添富基金工作。2015年加入博时基金管理有限公司，历任指数投资部总经理助理、指数投资部副总经理。现任指数与量化投资部副总经理兼博时标普500ETF基金(2016年5月16日至今)、博时标普500ETF联接(QDII)基金(2016年5月16日至今)、博时上证50ETF基金(2016年5月16日至今)、博时上证50ETF联接基金(2016年5月16日至今)的基金经理。

本基金历任基金经理：方维玲女士，2015年5月27日至2015年12月任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

委员：江向阳、邵凯、黄建斌、李权胜、顾国凡、魏凡春、王俊、过钧、白仲光

江向阳先生，简历同上。

邵凯先生，简历同上。

黄建斌先生，简历同上。

李权胜先生，硕士。2001年起先后在招商证券、银华基金工作。2006年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、特定资产投资经理、特定资产管理部副总经理、博时医疗保健行业股票基金基金经理、股票投资部副总经理、股票投资部成长组投资总监。现任董事总经理兼股票投资部总经理兼价值组投资总监、博时精选混合基金、博时新趋势混合基金的基金经理。

欧国凡先生，硕士，2003年起先后在南京证券、华泰证券、中国银河证券工作。2011年加入博时基金管理有限公司，管任特定资产管理部副总经理、社保组合投资经理助理。现任特定资产管理部总经理兼社保组合投资经理。

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

王俊先生，硕士，CFA，2008年从上海交通大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司，历任研究员、金融地产与公用事业组组长、研究部副总经理、博时国企改革股票基金、博时丝路主题股票基金的基金经理。现任研究部总经理兼博时主题行业混合(LOF)基金、博时沪港保质价值混合基金、博时沪港深成长混合基金、博时沪港深价值混合基金、博时沪港新趋势混合基金的基金经理。

过钧先生，硕士，CFA，1996年起先后在上海工艺品进出口公司、德国德累斯顿银行上海分行、美国Lowes食品有限公司、美国通用电气公司，华夏基金固定收益部工作。2006年加入博时基金管理有限公司，历任基金经理、博时稳定价值债券投资基金的基金经理、固定收益部副总经理、博时转债增强债券型证券投资基金、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金、博时标普分级债券型证券投资基金、博时长债增强债券型证券投资基金、博时新财富混合型证券投资基金的基金经理。现任董事总经理兼固定收益总部分募基金组投资总监、博时信用债券投资基金、博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）、博时新收益灵活配置混合型证券投资基金、博时新机遇混合型证券投资基金、博时新价值灵活配置混合型证券投资基金、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金、博时鑫源灵活配置混合型证券投资基金、博时鑫利灵活配置混合型证券投资基金、博时鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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

6、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用基金财产；

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）约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人公布；

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，基金托管人违反了法（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负责；

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。

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；

6、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益；

7、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

公司设立独立的监察部，监察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稽核和检查。

（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，监察部负责监察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）监察法律部

监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，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及时监督与控制。

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，确到基金经理分开，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，如电脑报警系统、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。

二 基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2017年9月30日，本集团总资产61,692.39亿元人民币，高级法下资本充足率15.01%，权重法下资本充足率12.26%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务部5个职能处室，现有员工76人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格的上市银行。2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品；在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只衍生品计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金份额申购、赎回当日划款、第一只跨外汇市场的QDII产品、第一只黄金产品、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务向定制投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联银行财资）“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺（财资）“中国最佳托管银行”称号；2016年1月，招商银行荣膺（证券时报）“托管通”获得国内（银行家）2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理（金贝奖）“最佳资产托管银行”；2017年6月再度荣膺（财资）“中国最佳托管银行”称号；“全功能网上托管银行2.0”荣获（银行家）2017中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8月荣膺财资经权威媒体（亚洲银行家）“中国年度托管银行奖”，进一步扩大银行托管业务在国际资管机构和托管业界的影响力。

（二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长，非执行董事，2014年7月起担任本行董事，董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士，吉林大学经济管理专业经济学硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长、兼任招商局金融集团有限公司董事长兼董事、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长兼董事、招商局港口控股有限公司董事长和招商局港口集团有限公司董事长、曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总经理。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2001年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生，本行副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991年至1995年，在中国科技国际信托投资公司工作；1996年6月至2001年10月，历任招商银行北京分行筹建处副主任、东二环支行行长助理、副行长、行长、北京分行筹建处主任、招商银行北京分行筹建处副主任；2001年10月至2003年6月，历任北京分行行长助理、副行长；2006年3月2008年6月，任北京分行党委书记、副行长（主持工作）；2008年6月至2012年6月，任北京分行行长、党委书记；2012年6月至2013年11月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013年11月至2014年12月，任招商银行总行行长助理；2016年11月起就任本行董事会秘书。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部副总、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20多年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）基金托管业务经营情况

截至2017年9月30日，招商银行股份有限公司累计托管316只开放式基金。