(上接B058版)

注册地址:上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
办公地址:上海市黄浦区中山南路100号17层
法定代表人:弭洪军
联系人:茅旦青
电话:021-33355392
传真:021-63353736
客户服务电话:400-876-5716
网址:www.cmiwm.com
(47)深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108
办公地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108
法定代表人:赖任军
联系人:刘昕霞
电话:0755-29330513
传真:0755-26920530
客户服务电话:400-930-0660
网址:www.jfzinv.com
(48)北京蛋卷基金销售有限公司
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:钟斐斐
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
(49)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:杨德红
联系人:芮敏祺
电话:021-38676666
传真:021-38670161
客户服务电话:95521
网址:www.gtja.com
(50)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:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:刘畅
电话:010-65608231
传真:010-65182261
客户服务电话:4008888108/95587
网址:http://www.csc108.com/
(51)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址:中国深圳福田区益田路江苏大厦A座30楼
法定代表人:霍达
联系人:黄婵君
电话:0755-82943666
传真:0755-83734343
客户服务电话:4008888111;95565
网址:http://www.newone.com.cn/
(52)广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广州市天河区马场路26号广发证券大厦
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
电话:020-87555888
传真:020-87555305
客户服务电话:95575或020-95575
网址:http://www.gf.com.cn/
(53)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层
法定代表人:陈共炎
联系人:辛国政
电话:010-83574507
传真:010-66568990
客户服务电话:95551/4008888888
网址:http://www.chinastock.com.cn/
(54)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/
(55)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45层
法定代表人:李梅
联系人:余敏
电话:021-33388252
传真:021-33388224
客户服务电话:95523或4008895523
网址:www.swhysc.com
(56)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人:王连志
联系人:刘志斌
电话:0755-82558323
传真:0755-82558355
客户服务电话:95517,4008001001
网址:http://www.essence.com.cn
(57)华泰证券股份有限公司
注册地址:南京市江东中路228号
办公地址:办公地址 南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦18楼
法定代表人:周易
联系人:庞晓芸
电话:0755-82492193
传真:0755-82492962(深圳)
客户服务电话:95597
网址:http://www.htsc.com.cn/
(58)方正证券股份有限公司
注册地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
办公地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:施华
联系人:程博怡
电话:010-56437060
传真:0731-85832214
客户服务电话:95571
网址:http://www.foundersc.com
(59)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:周健男
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/
(60)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
(61)国联证券股份有限公司
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:范炎
联系人:沈刚
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
客户服务电话:95570/4008885288(全国),0510-82588168(无锡)
网址:http://www.glsc.com.cn
(62)平安证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:广东省深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人:何之江
联系人:王超
电话:13321498768
传真:0755-82400862
客户服务电话:0755-22628888/95511-8
网址:http://www.stock.pingan.com
(63)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:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:李季
联系人:唐岚
电话:010-88085201
传真:010-88085195
客户服务电话:4008000562
网址:http://www.hysec.com
(64)中泰证券股份有限公司
注册地址:山东省济南市经十路20518号
办公地址:山东省济南市经七路86号23层
法定代表人:李玮
联系人:朱琴
电话: 021-20315161
传真: 0531-68889357
客户服务电话: 95538
网址: www.zts.com.cn
(65)德邦证券股份有限公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人:武晓春
联系人:刘熠
电话:021-68761616
传真:021-68767981
客户服务电话:4008888128
网址:http://www.tebon.com.cn
(66)西部证券股份有限公司
注册地址:陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16-17楼
办公地址:西安市西五路海惠大厦4层422室
法定代表人:刘建武
联系人:冯萍
电话:029-87406488
传真:029-87406387
客户服务电话:95582
网址:http://www.westsecu.com/
(67)华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人:黄金琳
联系人:张宗悦
电话:0591-87383623
传真:0591-87383610
客户服务电话:95547
网址:http://www.hfzq.com.cn
(68)华龙证券股份有限公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富大厦
法定代表人:李晓安
联系人:范坤/杨力
电话:0931-4890208,18993185278(范)/189
传真:0931-4890628
客户服务电话:95368/0931-48906194890618489010 0
网址:http://www.hlzqgs.com/
(69)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:刘婧漪、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
(70)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:曹欣
电话:029-88447611/18089157914
传真:86-29-88365835
客户服务电话:95325/400-860-8866
网址:www.kysec.cn
(71)联储证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店B座26楼
办公地址:深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店B座26楼
法定代表人:沙常明
联系人:丁倩云
电话:010-56177851
传真:0755-82075835
客户服务电话:4006206868/010-56177851
网址:http://www.lczq.com/
(72)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/
(73)泉州银行股份有限公司
注册地址:泉州市丰泽区云鹿路3号
办公地址:泉州市丰泽区云鹿路3号
法定代表人:傅子能
联系人:董培姗
电话:0595-22551071
传真:0595-22505215
客户服务电话:400-889-6312
网址:www.qzccbank.com
(74)华融湘江银行股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区芙蓉南路一段828号鑫远-杰座大厦
办公地址:湖南省长沙市天心区芙蓉南路一段828号鑫远-杰座大厦
法定代表人:刘永生
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.hrxjbank.com.cn

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:北京市建国门内大街18号恒基中心1座23层
法定代表人:张光华
电话:(010)65171166
传真:(010)65187068
联系人:许鹏

三、出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所
注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:安冬
经办律师:安冬、陆奇

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:王珊珊、贺耀
联系人:贺耀

四、基金的名称

博时量化价值股票型证券投资基金

五、基金的类型

股票型基金。

六、基金运作方式

本基金运作方式为契约型开放式,存续期间为不定期。

七、基金的投资目标

本基金运用量化方法,主要从市场相对估值、历史相对估值和重要股东增持价格三个方向衡量上市公司的估值高低,设计相应的量化策略选出具有估值优势的股票进行投资,力求获取超额收益。

八、投资范围

本基金主要投资于境内依法发行或上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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”)、权证、股指期货、债券(包含国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款、国债期货和现金,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)。

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的80%—95%,港股通标的股票的投资比例为股票资产的0%-50%;权证投资比例为基金资产净值的0-3%;每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或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。

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

九、投资策略

1、A股投资策略

本基金运用量化方法进行价值型投资,本基金管理人以自主研发的量化多策略体系为基础,对其中的价值型策略进行集中配置,在控制其他风格暴露的情况下突出组合的价值风格,获取长期超越市场的回报。

本基金管理人认为,在追求超额收益的过程中,估值是一个相对概念,价值型投资追求的是找到同等条件下具有估值优势的标的。本基金管理人的量化策略从以下三个方向刻画估值优势:第一,市场相对估值,即关注横截面市场上的低估值股票;第二,历史相对估值,即关注时间序列上的低估值股票;第三,重要股东增持估值,即关注市场价格低于重要股东增持价的股票。

从这三个方向出发,本基金管理人设计多个量化策略,每个策略自成逻辑和体系。进而,本基金管理人根据策略的风险收益特征、组合的容量需求以及基准的表现情况等选择其中的若干个策略进行配置,并通过一系列的组合优化方式,使得组合在控制主动风险的同时争取获得更为稳定的超额收益。

2、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。

3、债券投资策略

由于流动性管理及策略性投资的需要,本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益类证券以及可转换债券的投资。债券投资策略包括利率策略、信用策略等,由相关领域的专业研究人员提出独立的投资策略建议,经固定收益投资团队讨论,并经投资决策委员会批准后形成固定收益证券指导性投资策略。

针对可转换债券,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。

4、资产支持证券的投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券投资组合管理,并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略,严格遵守法律法规和基金合同,在力争本金安全和基金资产流动性基础上获得长期稳定收益。

5、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。

6、股指期货投资策略

本基金现阶段主要通过股指期货合约调节整体组合的市场风险。基金管理人将根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素,以套期保值为主要目的,计算需要用到的期货合约数量,对这个数量进行动态跟踪与测算,并进行适时灵活调整。同时,综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素,在各个月份期货合约之间进行动态配置,优化股指期货组合,创造额外收益。

7、国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

未来,随着中国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,基金可相应调整和更新相关投资策略。

十、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×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富(总值)指数收益率×10%。

沪深300指数是由中证指数有限公司编制,在上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数,该指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性,是目前中国证券市场中与本基金股票投资范围比较适配同时公信力较好的股票指数。恒生综合指数对香港市场优质企业股票具有较强的代表性,也较为全面的覆盖了港股通标的,适合作为本基金港股投资部分的业绩比较基准。中债综合财富(总值)指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,样本债券涵盖的范围全面,具有广泛的市场代表性,涵盖主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等),能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。

如果相关法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,基金管理人经与基金托管人协商一致,在按照监管部门要求履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告,而无须召开基金份额持有人大会。

十一、风险收益特征

本基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金,属于中高风险/收益的基金。

十二、基金投资组合报告

博时基金管理公司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2019年03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	金额元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	34,725,273.12	87.56
	其中:股票	34,725,273.12	87.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	153,000.00	0.39
	其中:债券	153,000.00	0.39
	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	4,585,553.99	11.56
8	其他各项资产	192,829.84	0.49
9	合计	39,656,656.95	100.00

2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	906,476.00	2.37
B	采矿业	728,784.00	1.90
C	制造业	17,889,095.18	46.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	890,180.00	2.32
E	建筑业	686,416.00	1.79
F	批发和零售业	2,300,695.00	6.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,157,896.00	3.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,584,163.94	4.13
J	金融业	4,456,885.00	11.63
K	房地产业	2,901,440.00	7.57
L	租赁和商务服务业	478,929.00	1.25
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	295,529.00	0.77
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	448,784.00	1.17
S	综合	-	-
	合计	34,725,273.12	90.61

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	002674	兴业科技	42,000	601,020.00	1.57
2	600015	华夏银行	69,200	570,900.00	1.49
3	300089	文化长城	80,500	539,350.00	1.41
4	600926	杭州银行	58,600	504,546.00	1.32
5	000789	万年青	30,100	465,346.00	1.21
6	600000	浦发银行	39,100	441,048.00	1.15
7	600279	重庆港九	67,500	438,750.00	1.14
8	002532	新界泵业	53,100	428,517.00	1.12
9	002128	露天煤业	46,200	420,882.00	1.10
10	300571	平治信息	7,100	418,616.00	1.09

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	-	-
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)	153,000.00	0.40
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	153,000.00	0.40

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	110053	苏银转债	1,350	135,000.00	0.35
2	110055	伊力转债	70	7,000.00	0.02
3	113530	大丰转债	70	7,000.00	0.02
4	128061	启明转债	40	4,000.00	0.01

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投资。

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

11.1本报告期内,本基金投资的前十名证券中没有出现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、处罚的情形。

11.2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。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	113,638.79
2	应收证券清算款	54,357.50
3	应收股利	-
4	应收利息	1,795.46
5	应收申购款	23,038.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	192,829.84

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。

十三、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

博时量化价值股票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
2018.06.26-2018.12.31	-13.26%	1.23%	-13.12%	1.28%	-0.14%	-0.05%
2019.01.01-2019.03.31	25.06%	1.57%	22.48%	1.25%	2.58%	0.32%
2018.06.26-2019.03.31	8.48%	1.36%	6.41%	1.28%	2.07%	0.08%

博时量化价值股票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
2018.06.26-2018.12.31	-13.62%	1.23%	-13.12%	1.28%	-0.50%	-0.05%
2019.01.01-2019.03.31	24.81%	1.57%	22.48%	1.25%	2.33%	0.32%
2018.06.26-2019.03.31	7.81%	1.36%	6.41%	1.28%	1.40%	0.08%

十四、基金费用与税收

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;
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、基金财产投资运营过程中的增值税;
12、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0.90%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.90%÷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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的,支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的,支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

3、C类基金份额的销售服务费

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0.80%。

本基金销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.80%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.80%÷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

销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付至登记机构,由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的,支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

上述“一、基金费用的种类”中第4-12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。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金管理人于2019年8月10日刊登的本基金原招募说明书(《博时量化价值股票型证券投资基金更新招募说明书2019年第2号》)进行了更新,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要补充和更新的内容如下:

1、在“重要提示”中,对所载内容截止日期、相关财务数据截止日期等数据进行了更新;
2、在“三、基金管理人”中,对基金管理人的基本情况进行了更新;
2、3、在“四、基金托管人”中,对基金托管人的基本情况进行了更新;
4、在“十三、基金费用与税收”中,对基金费用计提方法、计提标准和支付方式进行了更新;

博时基金管理有限公司
2019年11月26日

博时富乾纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务的公告

公告送出日期:2019年11月26日

1、公告基本信息

基金名称	博时富乾纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	博时富乾3个月定开债发起式
基金主代码	005631
基金运作方式	契约型基金。本基金以定期开放的方式运作。
基金合同生效日	2018年2月8日
基金管理人名称	博时基金管理有限公司
基金托管人名称	南京银行股份有限公司
基金注册登记机构名称	博时基金管理有限公司
公告依据	《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》等法律法规以及《博时富乾纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金合同》(以下简称“《基金合同》”)及《博时富乾纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》(以下简称“《招募说明书》”)
申购起始日	2019年11月29日
赎回起始日	2019年11月29日

2、申购、赎回业务的办理时间

(1)开放日及开放时间

本基金在开放期内,投资人在开放日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,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。在封闭期内,本基金不办理申购、赎回业务,也不上市交易。

基金合同生效后,若出现新的证券交易市场,证券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》的有关规定进行公告。

(2)开放期及业务办理时间

除法律法规或基金合同另有约定外,本基金每个封闭期结束之后第一个工作日起(含该日)进入开放期,开放期的期限为自封闭期结束之日后第一个工作日起(含该日)一至二十个工作日,具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明,但在开放期内,基金管理人有权延长开放期时间并公告,但开放期最长不可超过20个工作日。

本基金上一个封闭期为2019年8月29日至2019年11月28日,本基金本次办理申购与赎回业务的开放期为2019年11月29日至2019年12月26日,共20个工作日。2019年12月27日起,本基金将进入下一个封闭期,封闭期内本基金不办理申购与赎回业务。

本基金单一投资者持有的份额或构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过50%,本基金不向个人投资者销售。

如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据《基金合同》暂停申购与赎回业务的,基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告,在不可抗力或其他情形影响因素消除之日下一个工作日起,继续计算该开放期时间。

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。在开放期内,投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回、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基金份额申购、赎回的价格;但若投资人在开放期最后一日业务办理时间结束之后提出申购、赎回或者转换申请的,视为无效申请。

3、申购业务

(1)申购金额限制

投资人首次申购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)申购费率

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。

本基金基金份额采用前端收费模式收取基金申购费用。投资者的申购费用如下:

表:本基金份额的申购费率

金额(M)	申购费率
M<100万	0.80%
100万≤M<300万	0.50%
300万≤M<500万	0.30%
M≥500万	每笔1000元

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。

(3)其他与申购相关的事项

1)基金管理人可根据有关法律规定和市场情况,调整申购金额等数量限制,基金管理人必须最迟在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2)基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率或收费方式。费率或收费方式如发生变更,基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、赎回业务

(1)赎回份额限制

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基金份额余额少于10份时,余额部分基金份额必须一同赎回。

(2)赎回费率

表:本基金的赎回费率

持有时间	赎回费率
在同一开放期内申购后又赎回且持有期限少于7日的	1.50%
在同一开放期内申购后又赎回且持有期限大于等于7日的	0.10%
在非同一开放期申购后赎回	0%

来源:博时基金

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。向在同一开放期内申购后又赎回且持有期限少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产,向在同一开放期内申购后又赎回且持有期限大于等于7日的投资者收取的不低于赎回费总额的25%计入基金财产。

(3)其他与赎回相关的事项

1)基金管理人可根据有关法律规定和市场情况,调整赎回金额的数量限制,基金管理人必须最迟在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

2)基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整赎回费率或收费方式。费率或收费方式如发生变更,基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、基金销售机构

博时基金管理有限公司直销机构(含直销中心)。

6、基金份额净值公告的披露安排

(1)在基金封闭期内,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

(2)在基金开放期每个开放日的次日,基金管理人应通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

(3)基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

7、其他需要提示的事项

(1)本公告仅对博时富乾纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金本次办理申购、赎回业务等相关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,可于本基金管理人网站或相关销售机构查阅本基金相关法律文件及资料。本公告的解释权归本基金管理人所有。

(2)本基金以定期开放方式运作,本基金每个封闭期结束之后第一个工作日起进入开放期,开放期的期限为自封闭期结束之日后第一个工作日起(含该日)一至二十个工作日,具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。开放期内,本基金采取开放运作模式,投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。开放期未赎回的份额将自动转入下一个封闭期。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据《基金合同》暂停申购与赎回业务的,基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。

(3)2019年11月29日至2019年12月26日为本基金的本次开放期,即在开放期内接受办理本基金份额的申购、赎回业务,2019年12月26日15:00以后暂停接受办理本基金的申购、赎回业务。直至下