

3224 信息披露 | Disclosure

博时睿益事件驱动灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书摘要

[illegible]

本基金投资资产支持证券时,综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析,把资产违约机会与等级匹配,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后的收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益

(七)中小企业私募债投资策略

中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究,结合公司

[illegible]

2019年度行业分类行业的股票投资组合			
代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	--	--
B	采矿业	--	--
C	制造业	40,152,852.26	35.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,139,240.83	1.77
K	建筑业	--	--
F	批发和零售业	--	--
G	交通运输、仓储和邮政业	5,381,000.00	4.47
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,299,303.00	7.75
J	金融业	23,044,193.30	17.44
K	房地产业	4,532,500.00	3.78
L	租赁和商务服务业	--	--
M	科学研究和技术服务业	--	--
N	水利、环境和公共设施管理业	--	--
O	国防军工、医药和其他服务业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社会工作	--	--
R	文化、体育和娱乐业	--	--
S	综合	--	--
		93,036,995.89	79.04

2.报告期末公允价值(元)占基金资产净值比例大于或等于3%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	001918	工商银行	1,728,200	9,567,490.00	7.93

2	000031	三一重工	646.00	9,320,910.88	7.60
3	000111	中国矿业	89.20	7,702,060.00	6.43
4	000075	九州药业	272.00	7,270,720.00	6.00
5	000006	深纺织A	176.00	6,070,200.00	5.04
6	000051	格力电器	103.00	5,501,500.00	4.50
7	000010	神州药业	4.76	4,460,350.00	4.52
8	002683	燕巢股份	202.00	4,404,020.00	4.43
9	000002	万科A股	240.00	3,380,000.00	4.40
10	000000	浦发银行	220.00	4,940,400.00	4.09

6) 若按本表按品种分类的前五名的股票资产组合

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	工商银行	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	公司债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	3,912,320.00	3.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,912,320.00	3.24

6) 若按本表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	110004	通商银行转债	32,000	3,912,320.00	3.24

6) 若按本表按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

本基金未持有资产支持证券。

7) 若按本表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

本基金未持有贵金属。

[illegible]

基金管理人、基金托管人不得将本基金财产归入其固有财产, 投资所发生债权, 投资性有价证券不得归入其破产财产, 并不得与基金管理人、基金托管人固有财产及其他财产混同。

基金财产由基金托管人按照法律法规规定及基金合同约定的投资范围和投资比例进行投资。

期间	基金净资产增长率	基金净资产绝对增长率	基金净资产增长率与业绩比较基准收益差	跟踪误差	①—②	③—④
2016/01/01—2016/12/31	13.06%	0.00%	-1.30%	3.06%	-1.30%	-0.28%
2017/01/01—2017/12/31	-0.30%	0.00%	0.02%	0.32%	0.02%	0.22%
2018/01/01—2018/12/31	-10.79%	1.01%	-0.09%	10.91%	-1.12%	0.30%
2019/01/01—2019/06/30	1.30%	3.25%	0.30%	1.40%	0.40%	0.48%
2019/01/01—2019/09/30	2.60%	0.00%	13.35%	0.60%	13.35%	0.30%

十、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. 《基金合同》生效与基金相关的信息披露费用, 法律法规、中国证监会另有规定的除外;
4. 基金合同生效与基金相关的会计师事务所、律师费、审计费和诉讼费;
5. 基金上市费及年费;
6. 基金账户开户费;
7. 基金申购费、赎回费、销售费;
8. 按照国家有关规定, 在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用的计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

基金管理费按基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提, 逐月累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送划款指令, 经托管人复核后, 于次月首日起按照约定支付方式支付给基金管理人。基金托管人需向基金管理人出具划款指令, 并经双方核对一致后, 方可执行划款。费用自支付日起, 基金管理人应向托管人进行划付, 如发生顺延支付, 及顺延基金管理人向托管人支付。

2. 基金托管人的托管费

基金托管费按基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提, 逐月累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送划款指令, 经基金托管人复核后, 于次月首日起按照约定支付方式支付给基金托管人。基金托管人需向基金管理人出具划款指令, 并经双方核对一致后, 方可执行划款。

[illegible]

2019年6月28日，我单位召开了《关于博时旗下部分开放式基金增加北京汇成纳信有限公司为代销机构并开通定投业务公告》。

第 2 次：2019 年 7 月 1 日，我单位召开了《博时博时慧选事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）重新招募公告》。

（一）2019 年 6 月 28 日，我单位召开了《博时博时慧选事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）重新招募公告》。

（二）2019 年 6 月 28 日，我单位召开了《关于博时慧选事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）自 2019 年 6 月 28 日起暂停申购赎回业务的公告》。

（三）2019 年 6 月 28 日，我单位召开了《关于博时慧选事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）自 2019 年 6 月 28 日起暂停申购赎回业务的公告》。

（四）2019 年 6 月 28 日，我单位召开了《关于博时旗下部分开放式基金增加浙江恒利银行股份有限公司为代销机构和新增定投业务公告》。

（五）2019 年 6 月 28 日，我单位召开了《关于博时旗下部分开放式基金增加浙江恒利银行股份有限公司为代销机构和新增定投业务公告》。

（六）根据公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订招股说明书和公司章程。

博时基金管理有限公司
2019 年 6 月 28 日