

博时基金管理有限公司关于博时国证 2000 交易型开放式指数证券投资 基金修改招募说明书的公告

为更好地满足投资者的投资需求，博时基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下博时国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金（场内简称：国证 2000 指数 ETF；交易代码：159505）根据其标的指数成份股的定期调整情况，修订该基金招募说明书中涉及申购赎回现金替代的相关内容，并相应补充北京证券交易所股票的风险提示，本次修订自 2024 年 6 月 26 日起生效。主要修订如下：

博时国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书主要修订对照表

章节	原招募说明书内容	修订后更新招募说明书内容
重要提示	<p>3、本基金的标的指数为国证 2000 指数，编制方案如下：</p> <p>（1）选样空间</p> <p>满足下列条件的沪深 A 股和红筹企业发行的存托凭证：</p> <p>1) 非 ST、*ST 证券；</p> <p>2) 科创板证券上市时间超过 1 年，其他证券上市时间超过 6 个月；</p> <p>3) 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；</p> <p>4) 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；</p> <p>5) 考察期内证券价格无异常波动。</p> <p>...</p> <p>本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，并承担基金投资中出现的各类风险，包括市场风险、管理风险、技术风险、本基金特有风险及其他风险等。特有风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、流动性风险、标的指数变更的风险、指数编制机构停止服务的风险、跟踪误差控制未达约定目标的</p>	<p>3、本基金的标的指数为国证 2000 指数，编制方案如下：</p> <p>（1）选样空间</p> <p>满足下列条件的 A 股和红筹企业发行的存托凭证：</p> <p>1) 非 ST、*ST 证券；</p> <p>2) 科创板证券、北交所证券上市时间超过 1 年，其他证券上市时间超过 6 个月；</p> <p>3) 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；</p> <p>4) 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；</p> <p>5) 考察期内证券价格无异常波动。</p> <p>...</p> <p>本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，并承担基金投资中出现的各类风险，包括市场风险、管理风险、技术风险、本基金特有风险及其他风险等。特有风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、流动性风险、标的指数变更的风险、指数编制机构停止服务的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、成份股停牌的风险、</p>

	<p>风险、成份股停牌的风险、成份股退市的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、基金份额参考净值决策和基金份额参考净值计算错误的风险、退市风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、非深市成份股可以现金替代方式的风险、赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、股指期货投资风险、资产支持证券（ABS）的风险、股票期权风险、融资业务的主要风险、转融通证券出借的主要风险、国债期货投资风险、投资于存托凭证的风险、自动清算的风险等，详见本招募说明书“风险揭示”章节。</p>	<p>成份股退市的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、基金份额参考净值决策和基金份额参考净值计算错误的风险、退市风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、非深市成份股可以现金替代方式的风险、赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、股指期货投资风险、资产支持证券（ABS）的风险、股票期权风险、融资业务的主要风险、转融通证券出借的主要风险、国债期货投资风险、投资于存托凭证的风险、投资北交所股票的风险、自动清算的风险等，详见本招募说明书“风险揭示”章节。</p> <p>...</p> <p>本招募说明书（更新）所载内容截止日 2024 年 6 月 26 日。</p>
<p>第十部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>四、申购与赎回的程序</p> <p>（一）通过深圳证券交易所申购赎回</p> <p>3、申购和赎回的清算交收与登记</p> <p>本基金申购赎回过程中涉及的组合证券和基金份额、现金替代、现金差额、现金替代退补款及其他对价的清算交收适用中国证券登记结算有限责任公司及相关证券交易所最新的相关规则。</p> <p>对于本基金的申购业务采用多边净额结算的方式，即对本基金申购对应的份额、深市组合证券及其现金替代、沪市组合证券的现金替代采用多边净额结算；对于本基金的赎回业务采用多边净额结算的方式，即对本基金赎回对应的份额、深市组合证券及其现金替代、沪市组合证券的现金替代采用多边净额结算；本基金上述申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。</p> <p>七、申购赎回清单的内容与格式</p> <p>（一）通过深圳证券交易所申购赎回</p> <p>3、现金替代相关内容</p> <p>对于标志为可以现金替代的上海证券交易所上市的成份股，申购赎回基金份额时，均使用现金作为替代。</p> <p>（2）关于上海证券交易所成份证券可以现金替代的情形</p> <p>1）适用情形：适用于本基金成份股中上海证券交易所上市的股票。</p> <p>2）替代金额：</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在上海证</p>	<p>四、申购与赎回的程序</p> <p>（一）通过深圳证券交易所申购赎回</p> <p>3、申购和赎回的清算交收与登记</p> <p>本基金申购赎回过程中涉及的组合证券和基金份额、现金替代、现金差额、现金替代退补款及其他对价的清算交收适用中国证券登记结算有限责任公司及相关证券交易所最新的相关规则。</p> <p>对于本基金的申购业务采用多边净额结算的方式，即对本基金申购对应的份额、深市组合证券及其现金替代、沪市组合证券的现金替代、京市组合证券的现金替代采用多边净额结算；对于本基金的赎回业务采用多边净额结算的方式，即对本基金赎回对应的份额、深市组合证券及其现金替代、沪市组合证券的现金替代、京市组合证券的现金替代采用多边净额结算；本基金上述申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。</p> <p>七、申购赎回清单的内容与格式</p> <p>（一）通过深圳证券交易所申购赎回</p> <p>3、现金替代相关内容</p> <p>对于标志为可以现金替代的上海/北京证券交易所上市的成份股，申购赎回基金份额时，均使用现金作为替代。</p> <p>（2）关于上海/北京证券交易所成份证券可以现金替代的情形</p> <p>1）适用情形：适用于本基金成份股中上海/北京证券交易所上市的股票。</p> <p>2）替代金额：</p>

	<p>券交易所连续竞价期间，根据收到的深圳证券交易所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向上海证券交易所申报被替代证券的交易指令。</p> <p>...</p> <p>特例情况：若自 T 日起，上海证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p>	<p>实时申报的原则为：基金管理人在上海/北京证券交易所连续竞价期间，根据收到的深圳证券交易所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向上海/北京证券交易所申报被替代证券的交易指令。</p> <p>...</p> <p>特例情况：若自 T 日起，上海/北京证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p>
<p>第十 八部 分 风 险 揭 示</p>	<p>十五、非深市成份股可以现金替代方式的风险</p> <p>在通过深圳证券交易所申购赎回的模式中，上海证券交易所上市的成份股可以现金替代方式不同于现有其他现金替代方式，可能给申购和赎回投资者带来价格的不确定性，从而间接影响本基金二级市场价格折溢价水平。极端情况下，如果使用上海证券交易所可以现金替代证券的权重增加，该方式带来的不确定性可能导致本基金的二级市场价格折溢价处于相对较高水平。</p>	<p>十五、非深市成份股可以现金替代方式的风险</p> <p>在通过深圳证券交易所申购赎回的模式中，上海/北京证券交易所上市的成份股可以现金替代方式不同于现有其他现金替代方式，可能给申购和赎回投资者带来价格的不确定性，从而间接影响本基金二级市场价格的折溢价水平。极端情况下，如果使用上海/北京证券交易所可以现金替代证券的权重增加，该方式带来的不确定性可能导致本基金的二级市场价格折溢价处于相对较高水平。</p> <p>...</p> <p>二十五、投资北交所股票的风险</p> <p><u>本基金标的指数成份股可能包含北京证券交易所股票。北京证券交易所主要服务于创新型中小企业，在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异。本基金如投资北京证券交易所股票，可能面临的风险包括但不限于：</u></p> <p>1、中小企业经营风险</p> <p><u>北京证券交易所上市企业为创新型中小企业，该类企业往往具有规模小、对技术依赖高、迭代快、议价能力不强等特点，抗市场风险和行业风险能力较弱，存在因产品、经营模式、相关政策变化而出现经营失败的风险；另一方面，部分中小企业可能尚处于初</u></p>

	<p>步发展阶段，业务收入、现金流及盈利水平等具有较大不确定性，个股投资风险较大。因此，基金在追求北京证券交易所上市企业带来收益的同时，可能面临相关企业无法盈利甚至产生导致较大亏损的风险。</p> <p>2、股价大幅波动风险 北京证券交易所在证券发行、交易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所设置了更宽的涨跌幅限制（上市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%），可能导致较大的股票价格波动。</p> <p>3、退市风险 根据北京证券交易所退市制度，上市企业退市情形较多，一旦所投资的北京证券交易所上市企业进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，基金可能无法及时将该企业调出投资组合，从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，可能对基金净值造成不利影响。</p> <p>4、企业流动性风险 北京证券交易所投资门槛较高，个人投资者参与度相对较低；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱。若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，基金可能面临无法及时变现及其他相关流动性风险。</p> <p>5、监管规则变化的风险 北京证券交易所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致基金投资运作相应调整变化。</p>
--	--

本公告仅对本基金修订招募说明书的事项予以说明。上述修改事项对原基金份额持有人的利益无实质性不利影响，无需召开基金份额持有人大会。本公司将按规定在相应更新的招募说明书中对上述内容进行修改。

投资者欲了解本基金详细信息，请致电博时一线通 95105568（免长途话费）

或登录本公司网站 www.bosera.com 查阅本基金的基金合同、招募说明书及基金产品资料概要等文件及其更新，以及相关业务公告。

风险提示：基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人所管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

博时基金管理有限公司

2024年6月26日