

博时沪深300指数增强发起式证券投资基金(博时沪深300指数增强A)

基金产品资料概要

编制日期: 2020年12月11日

送出日期: 2020年12月12日

本概要提供本基金的重要信息, 是招募说明书的一部分。
作出投资决定前, 请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	博时沪深 300 指数增强	基金代码	010872
下属基金简称	博时沪深 300 指数增强 A	下属基金代码	010872
基金管理人	博时基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	-		
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	桂征辉	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2009-08-24
其他概况	本基金的基金合同生效三年后(指基金合同生效之日起三年后的对应日), 若基金资产净值低于两亿元的, 基金合同自动终止, 无需召开基金份额持有人大会审议, 且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续基金合同。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化, 上述终止规定被取消、更改或补充时, 则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

敬请投资者阅读《招募说明书》第九章了解详细情况

投资目标	本基金通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段, 在对标的指数有效跟踪的基础上, 力争实现超越目标指数的投资收益, 谋求基金资产的长期增值。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.50%, 年跟踪误差不超过7.5%。
投资范围	本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具, 包括标的指数成份股及其备选成份股(含存托凭证)、其他股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、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”)、债券(包括国内依法发行上市的国债、地方政府债、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、金融衍生品(股指期货、股票期权、国债期货)、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具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相关规定)。 本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。

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。

基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的0%-10%，投资标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，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；股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

主要投资策略

本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。1、股票投资策略（指数化投资策略、投资组合构建和优化、指数增强策略、股票组合调整、港股投资策略、存托凭证投资策略）；2、债券投资策略；3、衍生产品投资策略（股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略）；4、资产支持证券投资策略；5、融资及转融通证券出借业务投资策略

业绩比较基准

沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪沪深300指数，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。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

无

(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

无

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额(S)或金额(M) /持有期限(N)	收费方式/费率	备注
认购费	M < 50 万元	1.00%	
	50 万元 ≤ M < 100 万元	0.80%	
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.20%	
	M ≥ 500 万元	1000 元/笔	
申购费（前收费）	M < 50 万元	1.20%	
	50 万元 ≤ M < 100 万元	1.00%	
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.80%	

	M ≥ 500 万元	1000 元/笔	
赎回费	N < 7 天	1.50%	100%计入资产
	7 天 ≤ N < 30 天	0.50%	至少 25% 计入资产
	30 天 ≤ N < 180 天	0.25%	至少 25% 计入资产
	N ≥ 180 天	0.00%	

注：对于通过基金管理人直销渠道认购、申购的养老金客户，享受认购费率和申购费率1折优惠。对于通过基金管理人直销渠道赎回的养老金客户，将不计入基金资产部分的赎回费免除。

（二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	固定比例 0.80%
托管费	固定比例 0.15%
其他费用	基金合同生效后的指数许可使用基点费；《基金合同》生效后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；《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、公证费、诉讼费和仲裁费；基金份额持有人大会费用；基金的证券、期货、股票期权交易费用；基金的银行汇划费用；账户开户费用、账户维护费用；因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；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。

注：本基金交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

投资者应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等法律文件，及时关注本公司出具的适当性意见，各销售机构关于适当性的意见不必然一致，本公司的适当性匹配意见并不表明对基金的风险和收益做出实质性判断或者保证。基金合同中关于基金风险收益特征与基金风险等级因考虑因素不同而存在差异。投资者应了解基金的风险收益情况，结合自身投资目的、期限、投资经验及风险承受能力谨慎决策并自行承担风险，不应采信不符合法律法规要求的销售行为及违规宣传推介材料。

1、本基金特有风险

（1）被动投资的风险

1) 标的指数下跌的风险

本基金绝大部分基金资产将用于跟踪标的指数，业绩表现将会随着标的指数的波动而波动；同时本基金在多数情况下将维持较高的股票仓位，在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

2) 跟踪偏离的风险

本基金投资组合收益率可能由于标的指数调整成分股或变更编制方法、成分股派发现金红利、流动性风险（成分股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担较大的冲击成本）、本基金的运营费用（证券投资中的交易成本、基金管理费、托管费等）、债券投资等原因导致基金的收益率与业绩比较基准收益率发生较大偏离。

3) 标的指数变更的风险

根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的收益风险特征可能发生变化，投资者还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

(2) 股指期货投资风险

1) 杠杆风险

股指期货投资具有高杠杆特性，因此会放大基础资产所产生的盈利或损失，加大本基金收益的波动性。

2) 基差风险

基差是指股票指数现货价格与股指期货价格之间的差额。若本基金运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况，则可能对本基金投资产生影响。

3) 合约展期风险

本基金所投资的期货合约主要包括股指期货当月和近月合约。当基金所持有的合约临近交割期限，即需要向较远月份的合约进行展期，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。

4) 模型风险

股指期货合约属于虚拟投资品种，投资过程中需要通过模型进行风险定价，当投资人员使用了错误模型或者选择了不当的参数，会导致对风险或交易价格的估计错误而造成损失，损害本基金的投资收益。

(3) 国债期货投资风险

本基金的一部分资产将可能投资于国债期货，国债期货市场的风险类型较为复杂，涉及面广，具有放大性与可预防性等特征。其风险主要有由利率波动原因造成的市场价格风险、由宏观因素和政策因素变化而引起的系统风险、由市场和资金流动性原因引起的流动性风险、由交易制度不完善而引发的制度性风险以及由技术系统故障及操作失误造成的技术系统风险等。

(4) 资产支持证券（ABS）的风险

资产支持证券（ABS）是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券，所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等。

(5) 港股通机制下，港股投资风险

本基金投资范围为包括沪/深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，除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险。

(6) 新股申购风险

本基金可参与新股申购，新股发行政策、新股发行机制等影响新股发行的因素变动将会影响本基金的风险收益水平；新股配售比例、中签率的不确定性，或其他发售方式的不确定性以及上市后市场表现的不确定性使得本基金的投资收益不确定性有增加的风险。

(7) 股票期权风险

1) 流动性风险：由于股票期权合约众多，交易较为分散，股票期权市场的流动性一般较期货市场要低，尤其是深度实值和虚值的股票期权，成交量稀少，持有这些股票期权的投资者容易遇到无法成交、平仓出局的局面。

2) 价格风险：股票期权买方的价格风险即为他所付出的权利金，风险具有确定性。股票期权卖方的价格风险不定，不过其所收取的权利金可以提供相应保护，当发生亏损时，可以抵消部分损失。

3) 操作风险：操作风险是指由于管理不善或者制度执行出现问题等原因所导致的风险。股票期权作为一种衍生品，虽然可以用来管理风险，但若使用不当，也会产生巨额损失。

(8) 融资及转融通证券出借业务的主要风险

1) 流动性风险

出借人在出借证券后，除与借入人协商一致可提前了结的情形外，其他情形无法在合约到期前提前收回出借证券。当委托人拟赎回安排与投资入策略安排之间存在期限偏离，或当市场变化导致投资人员策略显著调整与前期合

约期限安排不匹配时，可能存在由于出借证券无法及时收回并变现而导致的流动性风险。

2) 交易对手违约风险

存在由于交易对手违约而导致证券到期不能按时或足额归还、相应权益补偿和借券费用不能支付等交易对手违约风险。

3) 市场风险

转融通出借收益按照证券当日收市后市值、融出日（或展期日）费率和实际出借天数计算，因此可能面临证券市值波动、费率变动而导致的市场风险。

4) 提前或延迟了结风险

证券出借期间，如发生标的证券范围调整、标的证券暂停交易、标的证券对应的上市公司被以终止上市为目的进行收购、终止上市等情况，可能面临合约提前了结或延迟了结的风险。

5) 跟踪误差风险

对于指数型组合，当组合发生大额赎回或市场大幅波动时，存在由于转融通出借证券无法提前了结并变现，单一股票占比被动上升而导致组合跟踪误差扩大的风险。

6) 杠杆效应放大风险

投资者通过融资及转融通证券出借业务可以扩大交易额度，利用较少资本来获取较大利润，这必然也放大了风险。投资者将股票作为担保品进行融资时，既需要承担原有的股票价格变化带来的风险，又得承担新投资股票带来的风险，还得支付相应的利息或费用，如判断失误或操作不当，会加大亏损。

7) 担保能力及限制交易风险

单只或全部证券被暂停融资及转融通证券出借业务、投资者账户被暂停或取消融资及转融通证券出借业务资格等，这些影响可能给投资者造成经济损失。此外，投资者也可能面临由于自身维持担保比例低于融资及转融通证券出借业务合同约定的担保要求，且未能及时补充担保物，导致信用账户交易受到限制，从而造成经济损失。

8) 强制平仓风险

投资者在从事融资交易及转融通证券出借业务期间，如果不能按照约定的期限清偿债务，或上市证券价格波动，导致日终清算后维持担保比例低于警戒线，且不能按照约定追加担保物时，将面临担保物被证券公司强制平仓的风险，由此可能给投资者造成经济损失。

9) 操作风险

融资交易和转融通业务具体实施过程中，在投资决策、交易等环节，可能面临由于操作人员操作失误、系统不完善等原因引发的操作风险。

10) 法律合规风险

在融资交易和转融通证券出借过程中，存在由于标的证券价格波动导致组合合规指标超标且无法进行调整的风险，以及在业务开展过程中发生操纵价格、利益输送等法律合规风险。

(9) 存托凭证投资风险。本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

(10) 自动清算的风险

基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于两亿元的，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。因此本基金有面临自动清算的风险。

(11) 当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，投资者不得办理侧袋账户份额的申购赎回等业务。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特

定风险。

2、本基金的其他风险：市场风险（政策风险、经济周期风险、利率风险、再投资风险、购买力风险、信用风险、债券回购风险等）、管理风险（决策风险、操作风险、技术风险等）、流动性风险、合规风险和其他风险。

（二）重要提示

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。

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

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新。其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：www.bosera.com][客服电话：95105568]

- （1）基金合同、托管协议、招募说明书
- （2）定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- （3）基金份额净值
- （4）基金销售机构及联系方式
- （5）其他重要资料

六、其他情况说明

争议解决方式：各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院（深圳仲裁委员会），按照深圳国际仲裁院（深圳仲裁委员会）届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用、律师费用由败诉方承担。