

博时中证可转债及可交换债券交易型开放式 指数证券投资基金基金份额发售公告



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

目 录

重要提示.....	1
一、本次发售基本情况.....	4
二、投资者开户.....	9
三、网上现金认购的程序.....	10
四、网下现金认购的程序.....	11
五、网下债券认购的程序.....	14
六、清算与交割.....	16
七、基金的验资与基金合同生效.....	17
八、本次发售当事人或中介机构.....	18
九、网下债券认购清单.....	23

重要提示

1、博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”或“转债ETF”)的募集已根据中国证监会2019年11月15日《关于准予博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》(证监许可[2019]2354号)注册。中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)对本基金的募集准予注册并不代表中国证监会对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或保证。

2、本基金是交易型开放式证券投资基金。

3、本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司(以下简称“本公司”),基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”),本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4、本基金发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

5、投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购三种方式认购本基金。网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构利用上海证券交易所网上系统以现金进行认购。网下现金认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行认购。网下债券认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以债券进行认购。

6、本基金自2020年2月10日起至2020年2月28日通过销售机构公开发售。其中,网下现金发售的日期为2020年2月10日起至2020年2月28日,网下债券发售的日期为2020年2月10日起至2020年2月28日,网上现金发售的日期为2020年2月26日起至2020年2月28日。如上海证券交易所对网上现金认购时间做出调整,我司将相应调整并及时公告。本公司可根据基金销售情况适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。

7、投资者认购本基金时需具有上海证券账户,上海证券账户是指上海证券交易所A股账户或基金账户。上海证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易,如投资人需要使用中证可转债及可交换债券指数成份券中的上海证券交易所上市债券参与网下债券认购或基金份额的申购、赎回,则应开立上海证券交易所A股账户。

8、基金管理人办理网下现金认购时可参照《博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》收取认购费用。基金管理人办理网下债券认购时不收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下债券认购时可参照《博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》收取一定的佣金。

9、网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额须为1000份或其整数倍。投资人可多次认购,累计认购份额不设上限。

网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的,每笔认

购份额须为1000份或其整数倍；投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在5万份以上（含5万份），投资人可多次认购，累计认购份额不设上限。

网下债券认购以单只债券申报，用于认购的债券必须是中证可转债及可交换债券指数的成份券和已经公告的备选成份券。单只债券最低认购申报数为1手（人民币1000元面值为1手），超过1手部分须为1手的整数倍。投资人可多次提交认购申请，累计申报数不设上限。

10、网上现金认购申请提交后，投资人可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。网下现金认购、网下债券认购申请提交后不得撤销。

11、销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。在基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

12、《博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）生效后，符合基金上市交易条件的，本基金基金份额可申请在上海证券交易所上市交易。上市交易的有关事项将另行公告。

13、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金的详细情况，请仔细阅读刊登在2020年1月22日《上海证券报》上的《博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

14、本基金的招募说明书及本公告发布在本公司网站（www.bosera.com）。

15、各发售代理机构办理认购业务的办理网点、办理日期和时间等事项参照各发售代理机构的具体规定。

16、在发售期间，除本公告所列的发售代理机构外，如变更或增加其他发售代理机构，本公司将及时公告，敬请留意近期本公司及各发售代理机构的公告

17、投资者可拨打博时一线通 95105568（免长途话费）或各发售代理机构电话咨询。

18、基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。

19、基金募集期结束后，基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商名单，报上海证券交易所，经上海证券交易所有关部门认可后，予以公告。基金上市后，指定交易未在申购赎回代理券商的投资人只能进行本基金的二级市场买卖，如投资人需进行本基金申购赎回交易，须指定交易或转指定交易到申购赎回代理券商。

20、风险提示

证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。证券投资基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，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。

本基金属于债券型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货

币市场基金。本基金在债券型基金中属于指数型基金，主要采用优化抽样复制法紧密跟踪标的指数的表现，本基金的业绩表现与中证可转债及可交换债券指数的表现密切相关。

证券投资基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。

本基金按照基金份额初始面值 1.00 元发售，在市场波动等因素的影响下，基金份额净值可能低于基金份额初始面值。

因折算、分红等行为导致基金份额净值变化，不会改变基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。本基金以 1 元初始面值开展基金募集或因折算、分红等行为导致基金份额净值调整至 1 元初始面值或 1 元附近，在市场波动等因素的影响下，基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于初始面值。

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：指数化投资的风险、标的指数的风险、跟踪偏离度和跟踪误差的风险、基金交易价格与份额净值发生偏离的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、套利风险、申购赎回清单差错风险、二级市场流动性风险、国债期货投资风险、退市风险、第三方机构服务的风险等。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

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。当投资人赎回时，所得会高于或低于投资人先前所支付的金额。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。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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

一、本次发售基本情况

(一) 基金名称

博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金

基金简称：博时可转债 ETF

场内简称：转债 ETF

基金认购代码：511383

一级市场申购赎回代码：511381

二级市场交易代码：511380

(二) 基金运作方式和类别

基金的运作方式：交易型开放式

基金的类别：债券型证券投资基金

(三) 存续期限：不定期。

(四) 基金份额初始面值：每份基金份额初始面值为 1.00 元人民币。

(五) 发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

(六) 销售机构

1、发售主协调人：

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/>

2、网下现金和网下债券发售直销机构

博时基金管理有限公司北京直销中心

办公地址：北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

电话：010-65187055

传真：010-65187032、010-65187592

联系人：韩明亮

博时一线通：95105568（免长途话费）

3、网上现金发售代理机构：

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理，具体名单可在上海证券交易所网站查询。

4、办理网下现金发售代理机构和网下债券发售代理机构：详见本公告“八（三）2、网下现金发售代理机构和网下债券发售代理机构”。

如本次募集期间，基金管理人变更网下现金发售代理机构和网下债券发售代理机构，将另行公告。

（七）发售时间安排与基金合同生效

1、发售时间安排

本基金的募集期限不超过 3 个月，自基金份额开始发售之日起计算。

本基金自 2020 年 2 月 10 日起至 2020 年 2 月 28 日通过销售机构公开发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购以及网下债券认购三种方式认购本基金。其中，网下现金发售的日期为 2020 年 2 月 10 日起至 2020 年 2 月 28 日，网下债券发售的日期为 2020 年 2 月 10 日起至 2020 年 2 月 28 日，网上现金发售的日期为 2020 年 2 月 26 日起至 2020 年 2 月 28 日。如上海证券交易所对网上现金认购时间做出调整，我司将相应调整并及时公告。本公司可根据认购的情况适当调整募集时间，但最长不超过法定募集期限，并予以公告。

2、基金备案条件

本基金自基金份额发售之日起三个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额（含网下债券认购所募集的债券按基金合同约定的估值方法计算的价值）不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。

3、基金募集失败

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

（1）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用。

（2）在基金募集期限届满后 30 日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；对于募集期间网下债券认购所募集的债券，登记结算机构应予以解冻，登记结算机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作。

（3）如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人及销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

（八）认购方式与费率

1、基金份额初始面值：本基金份额初始面值为 1.00 元人民币，认购价格为人民币 1.00

元。

2、认购费率

本基金的认购采用份额认购的原则。认购费用由认购基金份额的投资人承担，认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等发售期间发生的各项费用。认购费率如下表所示：

图表 1：认购费率

认购份额	认购费率
50万份以下	0.30%
50万份以上（含）—100万份以下	0.15%
100万份以上（含）	每笔500元

基金管理人办理网下现金认购时可参照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。投资人可以多次认购本基金，认购费以注册登记机构计算结果为准。

3、认购费用计算公式和收取方式

（1）网上现金认购

网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额须为 1000 份或其整数倍。投资人可多次认购，累计认购份额不设上限。

通过发售代理机构进行网上现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额的计算公式为：

$$\text{认购费用} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times \text{认购费率}$$

（或若适用固定费用的，认购费用=固定费用）

$$\text{认购金额} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times (1 + \text{认购费率})$$

（或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

认购费用由发售代理机构向投资人收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。

例：某投资人通过某发售代理机构以网上现金认购方式认购 1,000 份本基金，假设该发售代理机构确认的认购费率为 0.30%，则投资人需支付的认购费用和需准备的认购金额计算如下：

$$\text{认购费用} = 1.00 \times 1,000 \times 0.30\% = 3.00 \text{ 元}$$

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 1,000 \times (1 + 0.30\%) = 1,003.00 \text{ 元}$$

即投资人需准备 1,003.00 元资金，方可认购到 1,000 份本基金基金份额。

（2）网下现金认购

网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1000 份或其整数倍；投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 5 万份以上（含 5 万份），投资人可多次认购，累计认购份额不设上限。

1) 通过基金管理人进行网下现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额的计算公式为：

$$\text{认购费用} = \text{认购份额} \times \text{基金份额发售面值} \times \text{认购费率}$$

(或若适用固定费用的，认购费用=固定费用)

$$\text{认购金额} = \text{认购份额} \times \text{基金份额发售面值} \times (1 + \text{认购费率})$$

(或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用)

$$\text{利息折算的份额} = \text{利息} / \text{认购价格}$$

认购费用由基金管理人向投资人收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。

例：某投资人通过基金管理人以网下现金认购方式认购 100,000 份本基金，认购费率为 0.30%，利息为 10 元，则投资人需支付的认购费用和需准备的认购金额计算如下：

$$\text{认购费用} = 1.00 \times 100,000 \times 0.30\% = 300 \text{ 元}$$

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 100,000 \times (1 + 0.30\%) = 100,300 \text{ 元}$$

$$\text{利息折算的份额} = 10 / 1.00 = 10 \text{ 份}$$

$$\text{投资人实际可得份额} = 100,000 + 10 = 100,010 \text{ 份}$$

即，投资人需准备 100,300 元资金方可认购到 100,000 份本基金基金份额，但其最终实际所得的基金份额为 100,010 份。

2) 通过发售代理机构进行网下现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购费用和认购金额的计算公式为：

$$\text{认购费用} = \text{认购份额} \times \text{基金份额发售面值} \times \text{认购费率}$$

(或若适用固定费用的，认购费用=固定费用)

$$\text{认购金额} = \text{认购份额} \times \text{基金份额发售面值} \times (1 + \text{认购费率})$$

(或若适用固定费用的，认购金额=认购价格 × 认购份额+固定费用)

认购费用由发售代理机构向投资人收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。

例：某投资人到某发售代理机构网点认购 10,000 份本基金，假设该发售代理机构确认的认购费率为 0.30%，则需准备的资金金额计算如下：

$$\text{认购费用} = 1.00 \times 10,000 \times 0.30\% = 30 \text{ 元}$$

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 10,000 \times (1 + 0.30\%) = 10,030 \text{ 元}$$

即投资人需准备 10,030 元资金，方可认购到 10,000 份本基金基金份额。

(3) 网下债券认购

网下债券认购以单只债券申报，用于认购的债券必须是中证可转债及可交换债券指数的成份券和已经公告的备选成份券，具体以发售公告为准。单只债券最低认购申报数为 1 手(人民币 1000 元面值为 1 手)，超过 1 手部分须为 1 手的整数倍。投资人可多次提交认购申请，累计申报数不设上限。

1) 如投资人选择以现金支付认购费用/佣金则其可得到的基金份额和需支付的认购费用

/佣金如下:

$$\text{认购份额} = \frac{\sum_{i=1}^n (\text{第 } i \text{ 只债券在网下债券认购期最后一日的价值} \times \text{有效认购数量})}{\text{基金份额发售面值}}$$

认购费用/佣金=认购份额×基金份额发售面值×认购费率或佣金比率

2) 如投资人选择以基金份额的方式交纳认购费用/佣金, 则其可得到的基金份额和需支付的认购费用/佣金如下:

$$\text{认购份额} = \frac{\sum_{i=1}^n (\text{第 } i \text{ 只债券在网下债券认购期最后一日的价值} \times \text{有效认购数量})}{\text{基金份额初始面值}}$$

认购费用/佣金=认购份额×基金份额发售面值/(1+认购费率或佣金比率)×认购费率或佣金比率

净认购份额=认购份额-认购费用或佣金/基金份额发售面值

认购费用/佣金小数点后两位舍去。

如果投资人申报的个券认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限, 基金管理人则按照各投资人的认购申报数量同比例收取投资人提交认购的债券。

二、投资者开户

投资人认购本基金时需具有上海证券交易所 A 股账户或证券投资基金账户（以下统称“上海证券账户”）。

已有上海证券交易所 A 股账户或证券投资基金账户的投资人不必再办理开户手续。

尚无上海证券交易所 A 股账户或证券投资基金账户的投资人，需在认购前持本人身份证到中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的开户代理机构办理上海证券交易所 A 股账户或证券投资基金账户的开户手续。有关开设上海证券交易所 A 股账户和证券投资基金账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。

（一）如投资人需新开立证券账户，则应注意：

1、上海证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易，如投资人需要使用中证可转债及可交换债券指数成份券中的上海证券交易所上市债券参与网下债券认购或基金份额的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户。

2、开户当日无法办理指定交易，建议投资人在进行认购前至少 2 个工作日办理开户手续。

（二）如投资人已开立上海证券账户，则应注意：

1、如投资人未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

2、当日办理指定交易或转指定交易的投资人当日无法进行认购，建议投资人在进行认购前至少 1 个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

（三）使用专用交易单元的机构投资者则无需办理指定交易。

三、网上现金认购的程序

1、业务办理时间：2020年2月26日至2020年2月28日上午9:30-11:30和下午13:00-15:00（周六、周日及法定节假日不受理）。

2、认购手续：投资人在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。网上现金认购申请提交后，投资人可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。

（1）开立上海证券交易所A股账户或基金账户，办理指定交易在发售代理机构。

（2）在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

（3）投资者可通过填写认购委托单、电话委托、磁卡委托、网上委托等方式申报认购委托，可多次申报，申报一经确认，认购资金即被冻结。

具体时间和认购手续以上海证券交易所和发售代理机构的相关规则为准。

四、网下现金认购的程序

(一) 直销机构

1、业务办理时间：2020年2月10日起至2020年2月28日9:30-17:00（周六、周日及法定节假日不受理）。

2、到直销网点提供下列资料办理基金的认购手续：

投资人在认购本基金时，需按直销网点的规定，到直销网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后在直销网点规定的时间之后不得撤销。

(1) 个人投资者

- 1) 填妥并签字或签章的《ETF基金网下认购业务申请表》；
- 2) 投资者有效身份证件原件及签字复印件；
- 3) 上海证券交易所A股账户卡或基金账户卡；
- 4) 加盖银行受理印章的汇款凭证复印件；
- 5) 提供法律法规要求的投资者适当性管理及反洗钱等相关信息；
- 6) 公司要求提供的其他有关材料。

(2) 机构投资者

1) 填妥并加盖单位公章及法定代表人章或交易预留印鉴的《ETF基金网下认购业务申请表》；

- 2) 上海证券交易所A股账户卡或基金账户卡；
- 3) 加盖公章和法定代表人章的基金业务授权委托书；
- 4) 加盖单位公章经办人有效身份证件复印件；
- 5) 加盖单位公章的营业执照复印件（未换发三证合一营业执照的需同时提供加盖单位公章的组织机构代码证和税务登记证复印件）；
- 6) 加盖银行受理印章的汇款凭证复印件；
- 7) 提供法律法规要求的投资者适当性管理及反洗钱等相关信息；
- 8) 公司要求提供的其他有关材料。

4、在认购期内，将足额认购资金汇入本公司指定的任一直销资金专户：

(1) 中国工商银行直销专户：

账户名称：博时基金管理有限公司

银行全称：中国工商银行股份有限公司北京王府井金街支行

银行账号：0200000729027305830

人行同城交换号：1221

工行实时清算系统行号：20100042

人行跨行支付系统号：102100000072

(2) 中国建设银行直销专户：

账户名称：博时基金管理有限公司
银行全称：中国建设银行北京地坛支行
银行账号：11001042900056000600
同城交换号：429
联行行号：50190
人行支付系统机构号：105100002037

(3) 交通银行直销专户：

账户名称：博时基金管理有限公司
银行全称：交通银行北京分行营业部
银行账号：110060149018001401403
同城交换号：060149
联行行号：61113
人行支付系统机构号：301100000023

5、注意事项：

(1) 若投资人的认购资金在认购申请当日 17:00 之前未到本公司指定的直销资金专户，则认购申请无效。

(2) 办理汇款时，投资者必须仔细阅读《博时基金管理有限公司关于直销个人投资者汇款购买基金的提示性公告》，并注意以下事项：

1) 投资者必须使用其预留账户（投资者在本公司直销开立交易账户时登记的银行账户）办理汇款，如使用非预留账户、现金或其他无法及时识别投资者身份的方式汇款，则汇款资金无效；

2) 投资者应在汇款附言/用途/摘要/备注栏正确填写上海证券账户信息，并预留有效的联系方式，便于发生资金异常时及时通知；

3) 投资者应在每次使用预留账户汇款后于汇款当日 17 点前将汇款单传真至本公司汇款指定专用传真号码（010-65187032、010-65187592），并拨打电话（010-65187055）确认；

4) 投资者采用汇款交易方式发生的银行转账手续费由投资者自行承担；

5) 投资者应足额汇款，认购申请当日下午 17:00 之前，若投资者的认购资金未全额到本公司指定直销专户，则认购申请无效。

(二) 发售代理机构

1、业务办理时间：2020 年 2 月 10 日至 2020 年 2 月 28 日 9:30-17:00（周六、周日及法定节假日不受理），具体时间以各发售代理机构的规定为准。

2、认购手续：

投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足

认购资金。网下现金认购申请提交后不得撤销。

- (1) 开立上海 A 股账户或证券投资基金账户；
- (2) 在认购前向资金账户中存入足够的认购资金；
- (3) 投资人填写认购委托单，同时填写委托该发售代理机构代为办理网上现金认购的委托申请书。申报一经确认，认购资金即被冻结。

五、网下债券认购的程序

(一) 业务办理时间：2020年2月10日起至2020年2月28日，上述日期的9:30—17:00（周六、周日及法定节假日不受理），发售代理机构网下债券认购的具体业务办理时间由指定发售代理机构确定。

(二) 直销机构

1、机构投资者到直销网点提供下列资料办理基金的网下认购手续：

- (1) 填妥并加盖单位公章及法定代表人章或交易预留印鉴的《ETF 基金网下认购业务申请表》；
- (2) 上海证券交易所 A 股账户卡或深圳证券交易所 A 股账户卡复印件；
- (3) 加盖公章和法定代表人章的基金业务授权委托书；
- (4) 加盖单位公章的经办人有效身份证件复印件；
- (5) 加盖单位公章的营业执照复印件（未换发三证合一营业执照的需同时提供加盖单位公章的组织机构代码证和税务登记证复印件）。
- (6) 提供法律法规要求的投资者适当性管理及反洗钱等相关信息；
- (7) 公司要求提供的其他有关材料。

2、机构投资者到直销网点办理网下债券认购的程序：

- (1) 开立上海证券交易所 A 股账户。

上海证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易，如投资人需要使用中证可转债及可交换债券指数成份券中的上海证券交易所上市债券参与网下债券认购或基金份额的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户。

(2) 在交易所 A 股账户中具备足够的符合要求的中证可转债及可交换债券指数成份券和已公告的备选成份券。

(3) 投资人填写并提交《ETF 基金网下认购业务申请表》。登记机构将在募集结束后办理用以认购的债券的冻结业务，届时如投资人用以认购的债券的可用数量不足，则投资者的该笔债券认购申请无效。

具体认购程序以本公司直销机构的规定为准。

(三) 发售代理机构办理网下债券认购的程序

1、认购手续：

- (1) 开立上海证券交易所 A 股账户，办理指定交易或转指定交易。

如投资人需要使用中证可转债及可交换债券指数成份券中的上海证券交易所上市债券参与网下债券认购或基金份额的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户。

(2) 在 A 股账户中具备足够的符合要求的中证可转债及可交换债券指数成份券和已公告的备选成份券。

- (3) 投资人填写认购委托单。申报一经确认，认购债券即被冻结。

具体认购程序以发售代理机构的规定为准。

(四) 注意事项

开户当日无法办理指定交易，建议投资者在进行认购前至少 2 个工作日办理开户手续。
当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购，建议投资者在进行认购前至少 1 个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

六、清算与交割

（一）清算交收

1、网上现金认购：T 日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金，登记机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人于网上现金认购结束后的第 4 个工作日将实际到位的认购资金划往基金管理人预先开设的基金募集专户。

2、网下现金认购：T 日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人进行有效认购款项的清算交收。发售期结束后，基金管理人将于第 4 个工作日将汇总的认购款项及其利息划往基金募集专户。

T 日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金。在网下现金认购的最后一个工作日，各发售代理机构将每一个投资人账户提交的网下现金认购申请汇总后，通过上海证券交易所上网定价发行系统代该投资人提交网上现金认购申请。之后，登记机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人将实际到位的认购资金划往基金管理人预先开设的基金募集专户。

3、网下债券认购：T 日日终（T 日为本基金发售期最后一日），基金管理人初步确认各成份券的有效认购数量。登记结算机构根据基金管理人提供的确认数据，冻结上海市场网下认购债券，并将深圳市场网下认购债券过户至本基金组合证券认购专户。基金发售期结束后，基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资人应以基金份额方式支付的认购费用，并从投资人的认购份额中扣除，然后将扣除的认购费用以基金份额的形式返还给发售代理机构。

登记机构根据基金管理人提供的投资人净认购份额明细数据进行投资人认购份额的初始登记，并根据基金管理人报上海证券交易所确认的有效认购申请债券数据，将投资人申请认购的债券过户到基金的证券账户。

（二）募集资金利息与募集债券权益的处理方式

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资人所有，其中利息转份额以基金管理人的记录为准；网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资人基金份额；募集的债券在基金募集行为结束前任何人不得动用，该债券自认购日至登记机构进行债券过户日的期间所产生的权益归投资人所有。

（三）基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，上述资金及网下债券认购募集的债券在基金募集行为结束前任何人不得动用。基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

（四）本基金权益登记由登记机构在发售结束后完成过户登记。

七、基金的验资与基金合同生效

1、基金备案的条件

(1) 本基金自基金份额发售之日起三个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额（含网下债券认购所募集的债券按基金合同约定的估值方法计算的价值）不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。

(2) 基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。

(3) 基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，上述资金及网下债券认购募集的债券在基金募集行为结束前任何人不得动用。

2、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

(1) 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用。

(2) 在基金募集期限届满后 30 日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；对于募集期间网下债券认购所募集的债券，登记结算机构应予以解冻，登记结算机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作。

(3) 如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人及销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

八、本次发售当事人或中介机构

(一) 基金管理人

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： 广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层
法定代表人： 张光华
成立时间： 1998 年 7 月 13 日
注册资本： 2.5 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

(二) 基金托管人

名称： 招商银行股份有限公司
住所： 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
法定代表人： 李建红
成立时间： 1987 年 4 月 8 日
联系人： 张燕
联系电话： 0755—83199084

(三) 发售代理机构

1、网下现金发售的直销机构
博时基金管理有限公司，有关内容同上。
公司网址： www.bosera.com

2、网下现金发售代理机构和网下债券发售代理机构

(1) 发售主协调人：

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/>

(2) 网下现金发售和网下债券发售的其他代理机构:

1) 招商证券股份有限公司

注册地址:	深圳市福田区福田街道福华一路 111 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:	霍达
联系人:	黄婵君
电话:	0755-82943666
传真:	0755-83734343
客户服务电话:	95565
网址:	http://www.newone.com.cn/

2) 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:	http://www.gtja.com/

3) 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

4) 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/

5) 华安证券股份有限公司

注册地址:	安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号
办公地址:	安徽省合肥市南二环 959 号财智中心 B1 座
法定代表人:	章宏韬
联系人:	范超
电话:	0551-65161821
传真:	0551-65161672
客户服务电话:	95318
网址:	http://www.hazq.com/

6) 中信证券股份有限公司

注册地址:	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址:	北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦
法定代表人:	张佑君
联系人:	马静懿
电话:	010-60833889
传真:	010-84865560
客户服务电话:	400-889-5548/95548
网址:	http://www.cs.ecitic.com/

7) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址:	青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001
办公地址:	青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东 2、5 层； 济南市市中区经七路 156 号国际财富中心 15 层
法定代表人:	姜晓林
联系人:	孙秋月
电话:	0532-85022026
传真:	0532-85022605
客户服务电话:	95548
网址:	http://www.zxzqsd.com.cn/

8) 中信建投证券股份有限公司

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/

9) 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

10) 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:	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:	胡子豪
电话:	021-50531281
传真:	0755-82492962 (深圳)
客户服务电话:	95597
网址:	http://www.htsc.com.cn/

11) 长江证券股份有限公司

注册地址:	武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
办公地址:	武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
法定代表人:	尤习贵
联系人:	奚博宇
电话:	027-65799999
传真:	027-85481900
客户服务电话:	95579
网址:	http://www.95579.com/

(3) 仅做网下现金发售的其他代理机构:**1) 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
网址:	http://www.gf.com.cn/

3、网上现金发售代理机构

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理,具体名单可在上海证券交易所网站查询。

4、基金管理人可根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和本基金基金合同等规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。

(四) 登记机构

名称: 中国证券登记结算有限责任公司

注册地址: 北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址: 北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人: 周明

电话: 0755-25946013

传真: 0755-25987122

联系人: 严峰

(五) 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

(六) 审计基金财产的会计师事务所

名称: 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址: 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人: 李丹

联系电话: (021) 23238888

传真: (021) 23238800

联系人: 沈兆杰

经办注册会计师: 张振波、沈兆杰

九、网下债券认购清单

本基金募集期间，网下债券认购名单如下表所示。基金管理人可根据网下债券认购日前3个月个券的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个券认购规模进行限制，并在网下债券认购日前公告限制认购规模的个券名单。对于在网下债券认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个券，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该债券的认购申报。如遇中证可转债及可交换债券指数成份券调整，则最终确认可接受网下债券认购的清单以最终调整公告的成份券清单为准。

序号	代码	名称	序号	代码	名称
1	110059.SH	浦发转债	51	113545.SH	金能转债
2	113021.SH	中信转债	52	110034.SH	九州转债
3	113011.SH	光大转债	53	113543.SH	欧派转债
4	132015.SH	18中油EB	54	113516.SH	苏农转债
5	132018.SH	G三峡EB1	55	113554.SH	仙鹤转债
6	110053.SH	苏银转债	56	110033.SH	国贸转债
7	132013.SH	17宝武EB	57	113558.SH	日月转债
8	132009.SH	17中油EB	58	113534.SH	鼎胜转债
9	113026.SH	核能转债	59	113517.SH	曙光转债
10	113013.SH	国君转债	60	113551.SH	福特转债
11	132004.SH	15国盛EB	61	113518.SH	顾家转债
12	132007.SH	16凤凰EB	62	110060.SH	天路转债
13	110054.SH	通威转债	63	113544.SH	桃李转债
14	132020.SH	19蓝星EB	64	113550.SH	常汽转债
15	113008.SH	电气转债	65	110058.SH	永鼎转债
16	110061.SH	川投转债	66	113547.SH	索发转债
17	110051.SH	中天转债	67	113016.SH	小康转债
18	110046.SH	圆通转债	68	113549.SH	白电转债
19	132014.SH	18中化EB	69	110055.SH	伊力转债
20	113022.SH	浙商转债	70	113505.SH	杭电转债
21	113020.SH	桐昆转债	71	113527.SH	维格转债
22	110062.SH	烽火转债	72	113515.SH	高能转债
23	113014.SH	林洋转债	73	113519.SH	长久转债
24	110043.SH	无锡转债	74	113504.SH	艾华转债
25	113024.SH	核建转债	75	110050.SH	佳都转债
26	110045.SH	海澜转债	76	113540.SH	南威转债
27	110048.SH	福能转债	77	113027.SH	华钰转债
28	110065.SH	淮矿转债	78	113528.SH	长城转债
29	113009.SH	广汽转债	79	110038.SH	济川转债
30	132006.SH	16皖新EB	80	113542.SH	好客转债
31	132008.SH	17山高EB	81	113530.SH	大丰转债
32	132011.SH	17浙报EB	82	113557.SH	森特转债

33	110031.SH	航信转债	83	113537.SH	文灿转债
34	110042.SH	航电转债	84	113525.SH	台华转债
35	110047.SH	山鹰转债	85	113559.SH	永创转债
36	113028.SH	环境转债	86	113012.SH	骆驼转债
37	113508.SH	新风转债	87	113535.SH	大业转债
38	132021.SH	19 中电 EB	88	113538.SH	安图转债
39	132005.SH	15 国资 EB	89	113532.SH	海环转债
40	132012.SH	17 巨化 EB	90	113509.SH	新泉转债
41	132017.SH	19 新钢 EB	91	113555.SH	振德转债
42	113019.SH	玲珑转债	92	113553.SH	金牌转债
43	110041.SH	蒙电转债	93	113521.SH	科森转债
44	110063.SH	鹰 19 转债	94	113548.SH	石英转债
45	113025.SH	明泰转债	95	113556.SH	至纯转债
46	110056.SH	亨通转债	96	113541.SH	荣晟转债
47	113029.SH	明阳转债	97	113524.SH	奇精转债
48	110057.SH	现代转债	98	113531.SH	百姓转债
49	113017.SH	吉视转债	99	113030.SH	东风转债
50	110052.SH	贵广转债			

博时基金管理有限公司

2020 年 1 月 22 日