

# 博时标普500交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2021年9月27日

送出日期：2021年9月28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	博时标普 500ETF	基金代码	513500
基金管理人	博时基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
境外投资顾问	无	境外托管人	布朗兄弟哈里曼银行
基金合同生效日	2013-12-05	上市交易所及上市日期	上海证券交易所 2014-01-15
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	每个开放日开放申购、赎回
基金经理	万琼	开始担任本基金基金经理的日期	2015-10-08
		证券从业日期	2007-03-01
场内简称	标普 500		
扩位简称	标普 500ETF		

## 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》第十一章了解详细情况

#### 投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

#### 投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、境外上市交易的跟踪同一标的指数的公募基金。

为了更好地实现投资目标，本基金还可投资于依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生工具、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。其中，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。

本基金根据相关法律法规或中国证监会要求履行相关手续后，还可以投资于法律法规或中国证监会未来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。

本基金主要采取完全复制法实现对标的指数的紧密跟踪。

同时，为了更好地实现本基金的投资目标，本基金可适当借出证券。

为了减轻由于现金拖累产生的跟踪误差，本基金将用少量资产投资跟踪同一标的指数的股指期货，以达到最有效跟踪标的指数的投资目标。

## 主要投资策略

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

## 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标普500指数(S&P500Index(NTR, NettotalReturn))(经估值汇率调整，以人民币计价)。

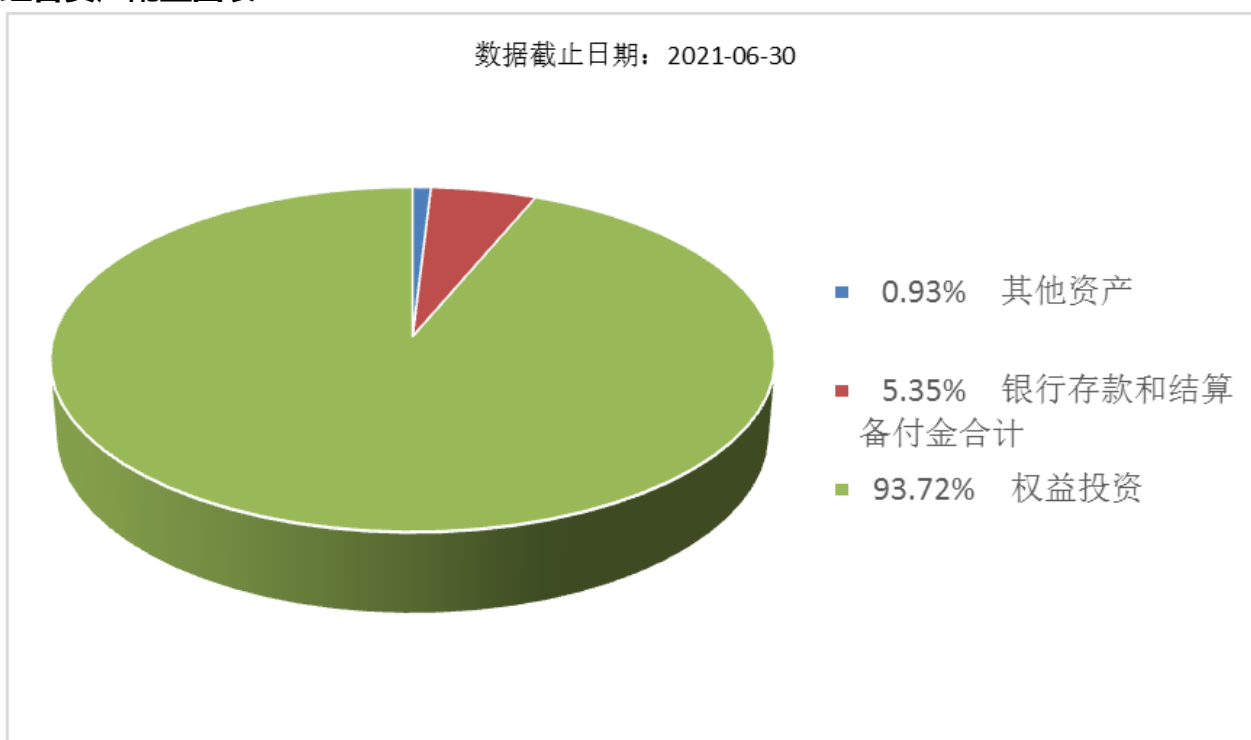
## 风险收益特征

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，属于高预期风险和高预期收益的基金品种。

本基金主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数相似。本基金主要投资于美国证券市场的股票，投资者需承担汇率风险。

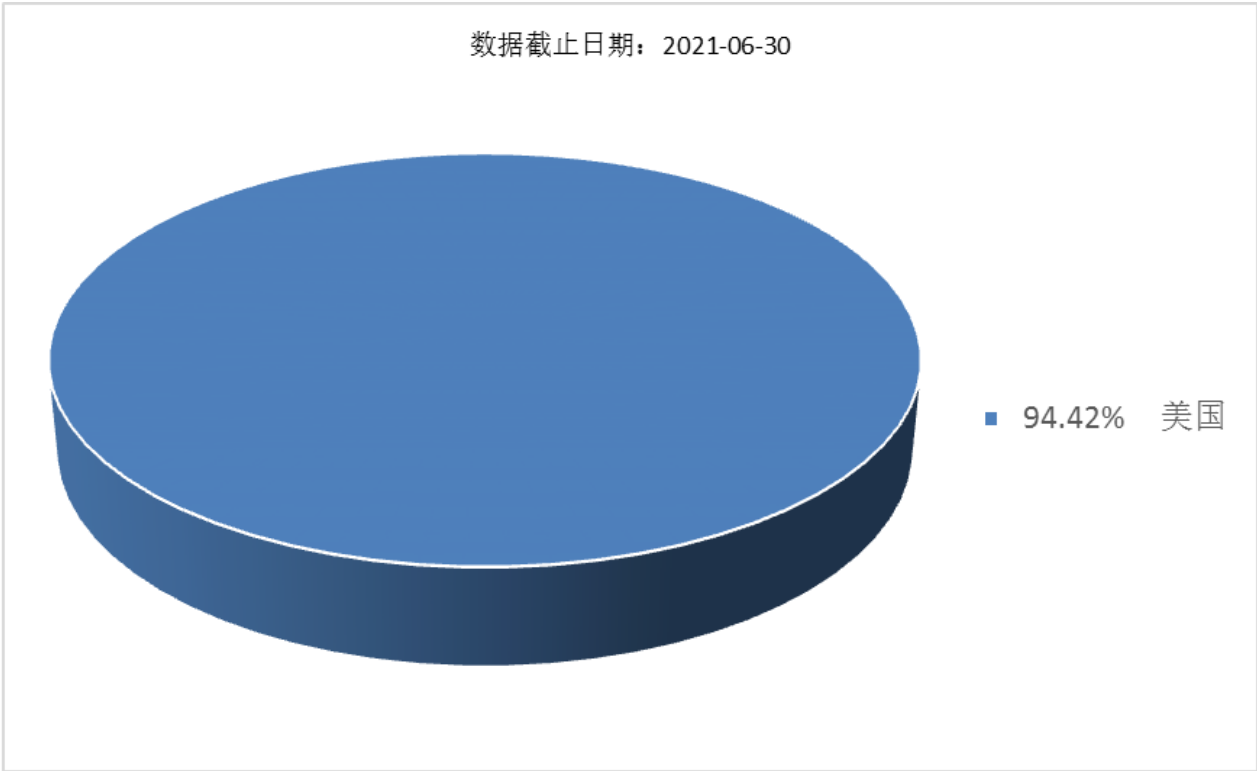
## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

### 投资组合资产配置图表

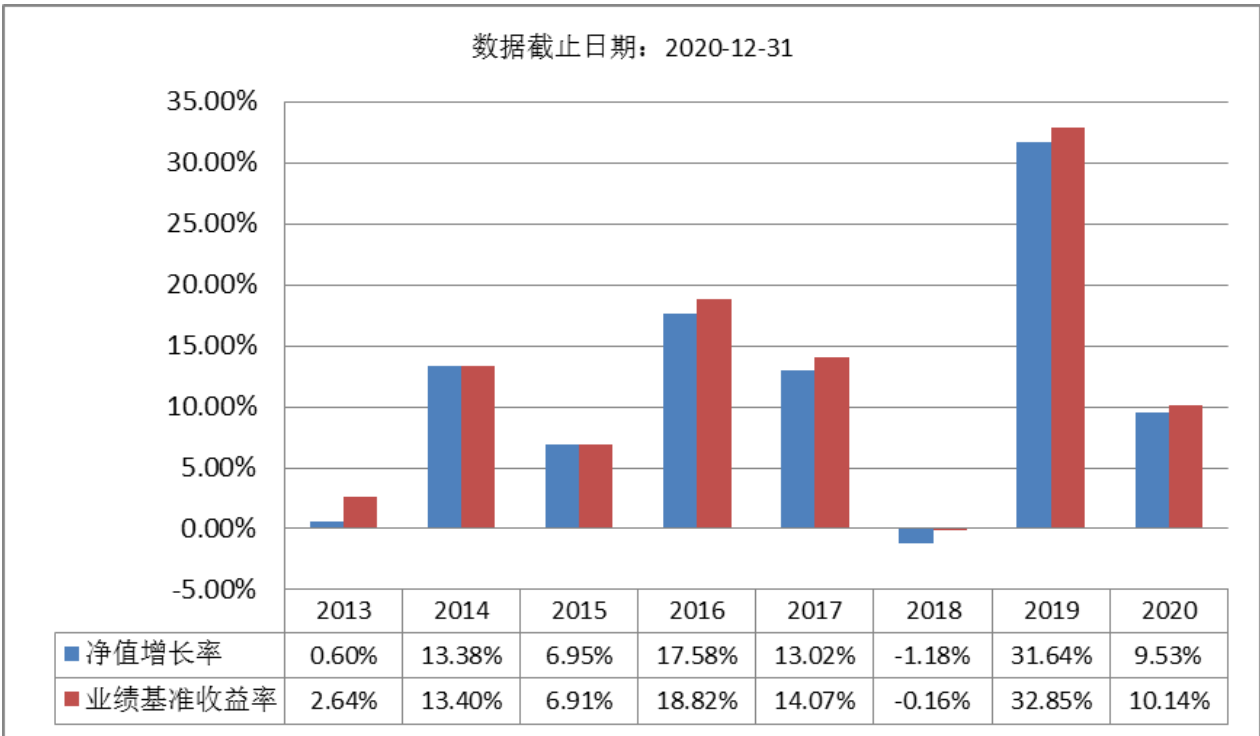


### 区域配置图表

数据截止日期：2021-06-30



**(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**



注：基金的过往业绩不代表未来表现。本基金的基金合同于2013年12月05日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

**三、投资本基金涉及的费用**

**(一) 基金销售相关费用**

场内交易费用以证券公司实际收取为准。

**申购费：**

投资人在申购基金份额时，代理券商可按照相应标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。最高不超过 0.5%。

## 赎回费：

投资人在赎回基金份额时，代理券商可按照相应标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。最高不超过 0.5%。

## （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 0.60%
托管费	固定比例 0.25%
其他费用	基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；基金的证券交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用；基金的指数使用费；基金份额持有人大会费用；基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费，税务顾问费；基金依照有关法律法規应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花稅及预扣提稅（以及与前述各项有关的任何利息及费用）；代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用；基金的银行汇划费用；与基金有关的诉讼、追索费用；基金上市初費及年費等

注：本基金交易证券等产生的费用和稅負，按实际发生額从基金资产扣除。

## 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、本基金的特定风险

##### （1）指数化投资风险：

1) 标的指数相关风险：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、指数编制的风险、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、成份股退市的风险、指数许可到期的风险

##### 2) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

##### 3) 与 ETF 投资相关的风险

##### ①基金份额赎回对价变現的风险

投资者在提出赎回申请时，基金组合证券变現可能由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资者收到的赎回对价可能延期交收或赎回对价的金额大幅波动。

##### ②基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

ETF 结构本身就存在着基金份额的二级市场交易价格（实时市价）与一级市场申购赎回价格（当日基金份额净值）之间产生相互偏离的可能性。

##### ③基金份额二级市场交易价格折溢价可能较国内单市场 ETF 高的风险

由于本基金的二级市场交易场所为境内的上海证券交易所，而本基金跟踪复制的标的指数则为境外美国股票指数，标的指数的投资活动发生在境外，以下原因可能造成跨境 ETF 的折溢价率高于国内单市场的 ETF。

##### ④基金管理人代理申赎投资人买券卖券的风险

因涉及境外市场股票的买卖，在投资人申购、赎回本基金时，本基金组合证券中全部或部分证券需以一定数量的现金进行现金替代，并由基金管理人按照招募说明书的规定代理申赎投资人进行相关证券买卖，投资人需承受买入证券的结算成本和卖出证券的结算金额的不确定性（含汇率波动风险）。

#### ⑤申购失败的风险

如果投资者申购时未能提供符合要求的申购对价，或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资者的申购申请，则投资者的申购申请失败。此外，如果基金可用的外汇额度不足，申购赎回代理券商应付资金不足或出现违约，投资者的申购申请也可能失败。

#### ⑥赎回失败的风险

如果投资人赎回时持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或者投资人在登记结算机构办理基金份额交收时持有的符合要求的基金份额不足，或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资人的赎回申请，则投资人的赎回申请失败。另外，基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位，由此可能导致投资人按原最小申购赎回单位申购并持有的基金份额无法按照新的最小申购赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

#### ⑦投资人参考 IOPV 做出投资决策的风险和 IOPV 计算错误的风险

IOPV 与实时的基金份额净值存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资人若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失。

#### ⑧退市风险

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，或因境外证券市场投资标的发生变更等不能继续投资，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

### （2）境外投资风险

#### 1) 境外市场风险

本基金属于美国股票指数基金的一种，标的指数成份股的投资收益可能会低于同期其他证券市场或其他资产类别的投资收益。

本基金主要资产投资于美国证券或美元现金，基金表现受美国宏观经济运行情况、货币政策、财政政策、产业政策、税法、汇率、交易规则、结算、托管等多种因素的影响。

#### 2) 外汇风险

外汇风险包括但不限于汇率风险、利率风险、外汇政策风险等。由于跨境 ETF 涉及到人民币与外币的汇兑，汇率、利率的变动以及美国外汇政策的改变均会产生一定的外汇风险。

### （3）金融衍生品投资风险

本基金可投资于期货、期权等衍生品。本基金管理人将谨慎的使用衍生品投资，但衍生品仍可能给基金带来额外奉献，包括杠杆风险、交易对手的信用风险、衍生品价格与其基础品种的相关度降低带来的风险等，有此可能会增加基金净值的波动幅度。

2、本基金普通风险：市场风险（政策风险、经济周期风险、收益波动风险、利率风险、通货膨胀风险、再投资风险等）、管理风险（决策风险、操作风险、技术风险、估值风险等）、信用风险、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核准，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](http://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，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。