

博时中证农业主题指数型发起式证券投资基金（博时中证农业主题指数发起式A）基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月25日

送出日期：2024年6月26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	博时中证农业主题指数发起式	基金代码	017019
下属基金简称	博时中证农业主题指数发起式A	下属基金代码	017019
基金管理人	博时基金管理有限公司	基金托管人	财通证券股份有限公司
基金合同生效日	2022-12-13		
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	王祥	开始担任本基金基金经理的日期	2022-12-13
		证券从业日期	2012-07-01
其他条款	本基金在基金合同生效三年后继续存续的，基金存续期内，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会，同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

敬请投资者阅读更新的《招募说明书》第八章了解详细情况

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。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，预期年化跟踪误差不超过 4%。
投资范围	本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于依法发行上市的非成份股（包括主板、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）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权）、债券回购、货币市场工具（包括银行存款、同业存单等）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的相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。未来在法律法规允许的前提下，本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。

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。

本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%，投资港股通标的股票的比例不超过本基金股票资产的10%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者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、存出保证金和应收申购款等；股指期货、股票期权、国债期货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。

若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

主要投资策略

本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。

在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于0.35%，预期年化跟踪误差不超过4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金日均跟踪偏离度和跟踪误差变大，基金管理人应采取合理措施，避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

本基金的其他投资策略还包括债券（除可转换债券和可交换债券）投资策略、港股通标的股票投资策略、资产支持证券的投资策略、可转换债券投资策略、衍生品投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略等。

业绩比较基准

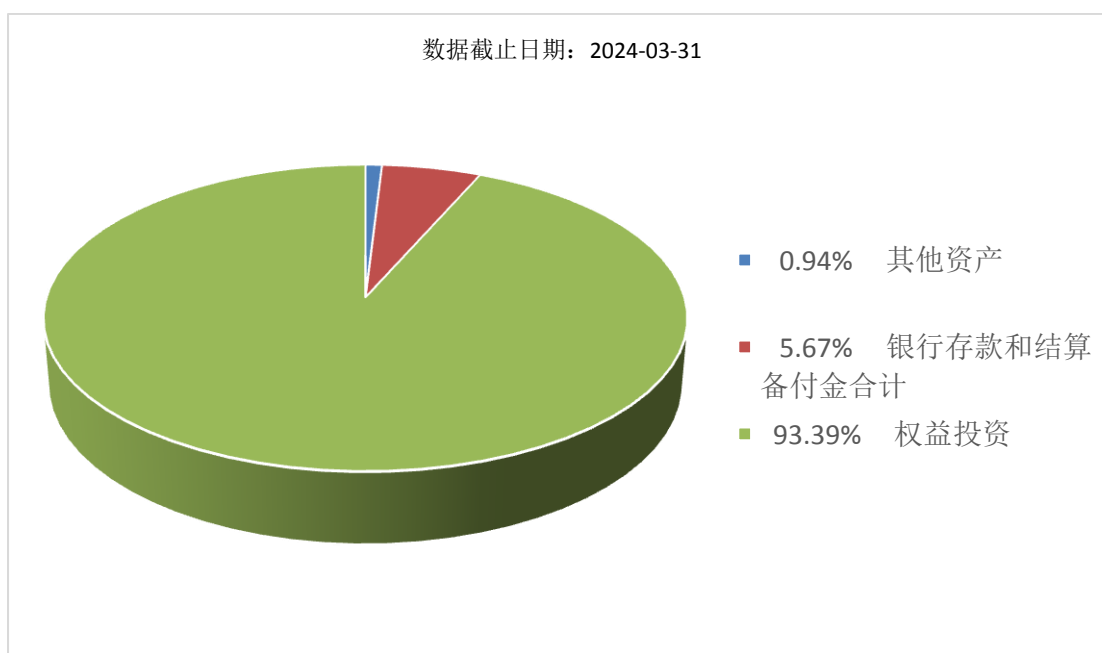
中证农业主题指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

风险收益特征

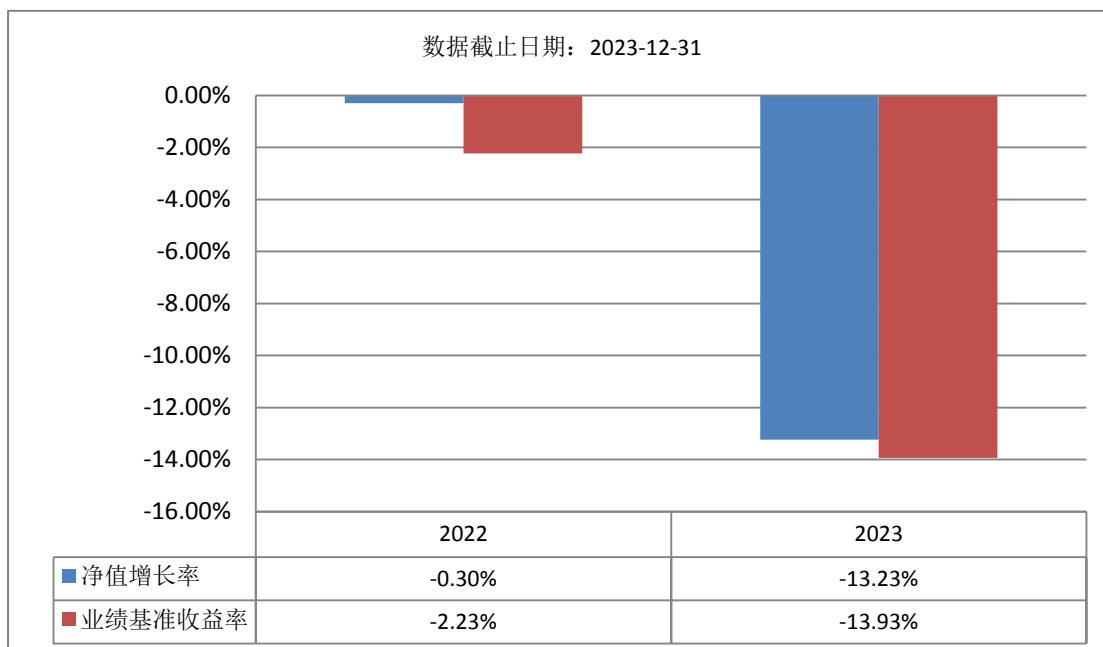
本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证农业主题指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表



(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。本基金份额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

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
申购费（前收费）	M < 100 万元	1.00%	
	100 万元 ≤ M < 300 万元	0.50%	
	M ≥ 300 万元	300.00 元/笔	
赎回费	N < 7 天	1.50%	100%计入资产
	N ≥ 7 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。

（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/年费率或金额	收取方
管理费	固定比例 0.50%	基金管理人、销售机构
托管费	固定比例 0.10%	基金托管人
审计费用	35,000.00	会计师事务所
信息披露费	-	规定披露报刊
其他费用	基金合同生效后与本基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用等，详见招募说明书或其更新“基金的费用与税收”章节。	

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、本基金运作相关费用年金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

	基金运作综合费率（年化）
基金运作综合费率	0.86%

注：基金管理费率、托管费率为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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）标的指数的风险

即标的指数因为编制方法的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现存在差异，因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大，增加基金投资成本，并有可能因此而增加跟踪误差，影响投资收益。

2）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。

3）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。

4）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。

5）指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。因此，投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

6）成份股停牌的风险

7）成份股退市的风险

8）跟踪误差控制未达约定目标的风险

（2）投资股指期货的风险

具体包括杠杆风险、基差风险、合约展期风险、模型风险。

（3）投资国债期货的风险

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）投资股票期权的风险

具体包括流动性风险、价格风险、操作风险。

(5) 投资资产支持证券 (ABS) 的投资风险

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。

(6) 港股通机制下, 港股投资风险

本基金投资范围包括港股通标的股票, 若本基金投资于港股通标的股票, 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, 本基金还可能面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险。

(7) 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。

(8) 融资和转融通证券出借业务的主要风险

具体包括流动性风险、交易对手违约风险、市场风险、提前或延迟了结风险、跟踪误差风险、杠杆效应放大风险、担保能力及限制交易风险、强制平仓风险、操作风险、法律合规风险等。

(9) 投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证, 除与其他仅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

本基金的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基金合同。本基金在基金合同生效后继续存续的, 基金存续期内, 连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的, 基金管理人应当在定期报告中予以披露; 连续 50 个工作日出现前述情形的, 本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止, 且无需召开基金份额持有人大会, 同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。因此本基金有面临自动清算的风险。

2、本基金普通风险: 市场风险 (政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险、信用风险、债券回购风险、上市公司经营风险) 管理风险、流动性风险、合规性风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险和其他风险等。

(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

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。