

# 博时纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 ( QDII ) ( 博时纳斯达克100ETF发起式联接 ( QDII ) A美元现汇 )

## 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	博时纳斯达克 100ETF 发起式联接 ( QDII )	基金代码	016055
下属基金简称	博时纳斯达克 100ETF 发起式联接 ( QDII ) A 美元现汇	下属基金代码	016056
基金管理人	博时基金管理有限公司	基金托管人	中信银行股份有限公司
境外投资顾问	不适用	境外托管人	美国花旗银行有限公司
基金合同生效日	2022-07-26		
基金类型	股票型	交易币种	美元
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	万琼	开始担任本基金基金经理的日期	2023-09-26
		证券从业日期	2007-03-01
其它概况	本基金为发起式基金，《博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 ( QDII ) 基金合同》生效之日 ( 即 2022 年 7 月 26 日 ) 起三年后的对应日，若基金资产净值低于两亿元 ( 美元折算为人民币 ) 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。本基金在《博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 ( QDII ) 基金合同》生效 ( 即 2022 年 7 月 26 日 ) 三年后继续存续的，基金存续期内，连续 50 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 ( 美元折算为人民币 ) 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。		

### 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》第四章了解详细情况

投资目标	通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数即纳斯达克100指数的表现，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%。
------	---

本基金主要投资于目标ETF、标的指数即纳斯达克100指数成份股和备选成份股票（含存托凭证）。

为更好地实现投资目标,本基金还可投资于境外市场和境内市场依法发行的金融工具,其中境外市场投资工具包括在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF);依法发行上市的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”);已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证(包括全球存托凭证,美国存托凭证等),房地产信托凭证:政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券、银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品;远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的期权、期货等金融衍生产品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。

## 投资范围

境内市场投资工具包括国内依法发行或上市的股票(包括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)、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)、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)、国债期货、股指期货、股票期权、货币市场工具(包括银行存款、同业存单等)、债券回购、资产支持证券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。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,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:本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%;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,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许,基金管理人在与基金托管人协商一致并履行适当程序后,可对上述资产配置比例进行调整。

## 主要投资策略

本基金主要投资于目标ETF,方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金不参与目标ETF的投资管理。为实现投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于境外市场和境内市场依法发行的金融工具,其目的是为了本基金在保障日常申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。

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。其他投资策略包括基金投资策略、股票及存托凭证投资策略、债券(除可转换债券)投资策略、资产支持证券投资策略、港股通标的股票投资策略、可转换债券投资策略、融资和转融通证券出借策略、存托凭证投资策略、金融衍生品投资策略等。

## 业绩比较基准

经汇率调整的纳斯达克100指数收益率x95%+活期存款利率(税后)x5%

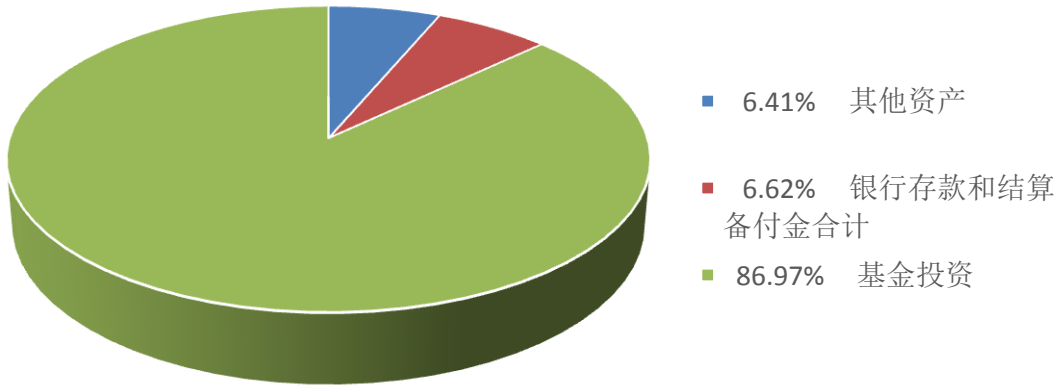
## 风险收益特征

本基金为ETF联接基金,通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。同时,本基金为被动式投资的股票指数基金,跟踪纳斯达克100指数,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。本基金投资于境外证券,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

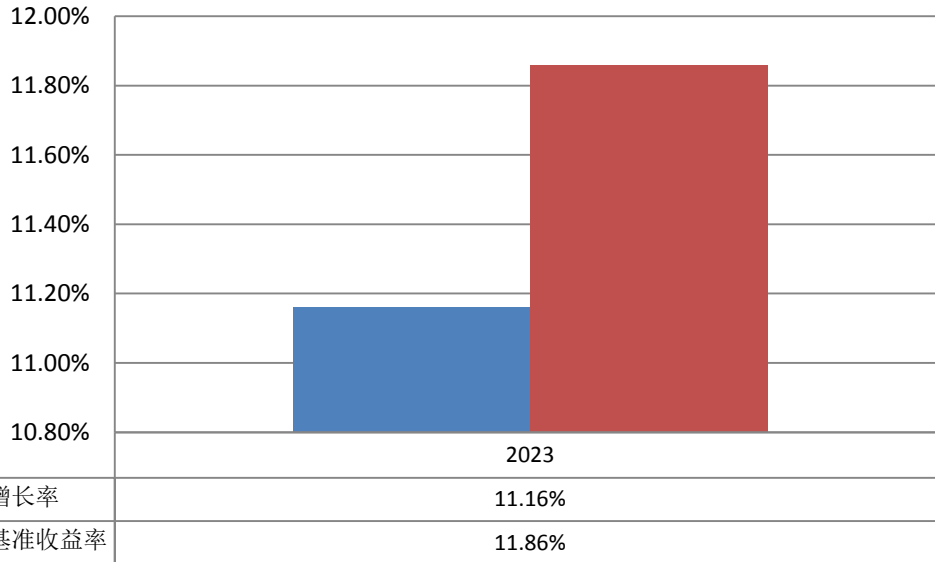
### 投资组合资产配置图表

数据截止日期：2024-03-31



### (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

数据截止日期：2023-12-31



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 < 20 万元	1.00%	
	20 万元 ≤ M < 60 万元	0.50%	
	M ≥ 60 万元	200.00 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。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/年费率或金额	收取方
管理费	固定比例 0.50%	基金管理人、销售机构、投资顾问机构
托管费	固定比例 0.15%	基金托管人
审计费用	38,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	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。

3、本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费和托管费。

## （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	0.66%

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）指数化投资风险

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）标的指数波动的风险：标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

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，基金的投资组合随之调整，基金收益风险特征可能发生变化，投资人需承担投资组合调整所带来的风险与成本。

4）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。

#### 5) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

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%，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

#### 6) 成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

① 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

② 在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回款项，由此基金管理人可能设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

#### 7) 成份股退市的风险

标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。

#### 8) 投资于目标 ETF 基金带来的风险

由于主要投资于目标 ETF，所以本基金会面临诸如目标 ETF 的管理风险与操作风险、目标 ETF 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、目标 ETF 的技术风险等风险。

(2) 开通外币申赎的风险。本基金开通了外币申购和赎回业务，在方便投资者的同时，也增加了相关业务处理的复杂性，从而带来相应的风险，增加投资者的支出和基金运作成本。此外，外币对人民币的汇率大幅波动也可能加大人民币份额基金净值波动的幅度。由于本基金外币份额的净值计算与汇率挂钩，外币对人民币的汇率大幅波动也可能加大外币份额净值波动的幅度。

(3) 引入境外托管人的风险。本基金由境外托管人提供境外资产托管服务，包括税收风险、法律风险等。

(4) 投资风险。包括投资股票期权、资产支持证券、股指期货、国债期货的风险、参与融资和转融通证券出借业务的主要风险等。

(5) 自动清算的风险。本基金为发起式基金，《博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》生效之日（即 2022 年 7 月 26 日）起三年后的对应日，若基金资产净值低于两亿元（美元折算为人民币）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。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。

本基金在《博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》生效（即 2022 年 7 月 26 日）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（美元折算为人民币）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，本基金面临自动清算的风险。

### 2、海外投资风险

本基金主要投资于境外市场，面临海外市场风险、政府管制风险、监管风险、政治风险、汇率风险、利率风险、衍生品风险、信用风险、法律及税务风险、交易结算风险、证券借贷/正回购/逆回购风险、港股通机制下，港股投资风险、金融模型风险等。

### 3、其他风险

包括流动性风险、操作风险、会计核算风险、第三方机构服务的风险、管理风险、不可抗力风险等。

## (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

**1、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。

争议处理期间，基金管理人、基金托管人应恪守基金管理人和基金托管人的职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和基金托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

**2、转型情况说明：**自 2023 年 9 月 26 日起，博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金（QDII）正式变更为博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）。