

博时创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2021年12月16日

送出日期：2021年12月17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	博时创业板两年定开混合	基金代码	160529
基金管理人	博时基金管理有限公司	基金托管人	中国银行股份有限公司
基金合同生效日	2020-09-03	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所 2021-03-17
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	定期开放式	开放频率	2年定期开放申购和赎回
基金经理	郭晓林	开始担任本基金基金经理的日期	2020-09-03
		证券从业日期	2012-07-13
其他概况说明	基金合同生效后，连续五十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，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。基金合同生效后，若登记机构完成每个开放期最后一个开放日的申购、赎回业务申请确认时，本基金的基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元，基金管理人在履行相关监管报告和信息披露程序后终止基金合同而无需召开基金份额持有人大会。本基金将根据基金合同第二十部分的约定进行基金财产清算。		
扩位简称	创业板博时定开		

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》第十章了解详细情况

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资范围	本基金投资于国内依法发行上市的股票（包括中小板、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（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债、次级债等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、国债期货、股票期权，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)。

本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资和转融通证券出借业务，亦可在封闭期内通过战略配售的方式进行股票投资。

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，本基金可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票（含存托凭证）的比例不低于基金资产的60%，投资于创业板的股票资产的比例不低于非现金基金资产的80%；港股通标的股票的投资比例为股票资产的0%-50%；但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前两个月、开放期及开放期结束后两个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。在开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；在封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；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，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

在封闭期内，本基金以创业板相关股票投资策略和固定收益投资策略为主，并辅以战略配售股票投资策略等。创业板实施注册制改革以后的定位是：深入贯彻创新驱动发展战略，适应发展更多依靠创新、创造、创意的大趋势，主要服务成长型创新创业企业，支持传统产业与新技术、新产业、新业态、新模式深度融合。封闭期内本基金的主要投资策略包括大类资产配置策略、创业板相关股票投资策略、股票战略配售投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、融资和转融通证券出借业务。

开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。

业绩比较基准

创业板综合指数收益率×60% + 中证港股通综合指数（人民币）收益率×10% + 中债综合财富（总值）指数收益率×30%

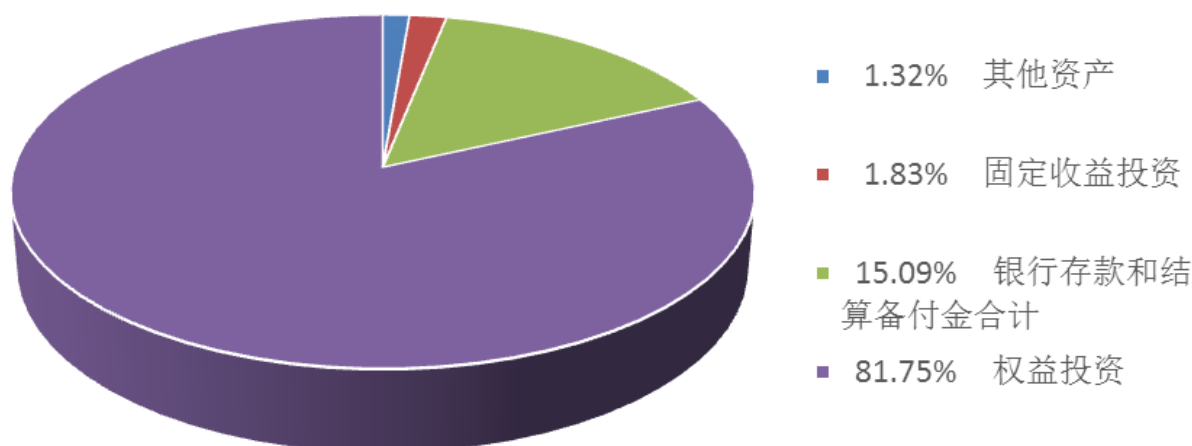
风险收益特征

本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。本基金以投资创业板股票为主要投资策略，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。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。

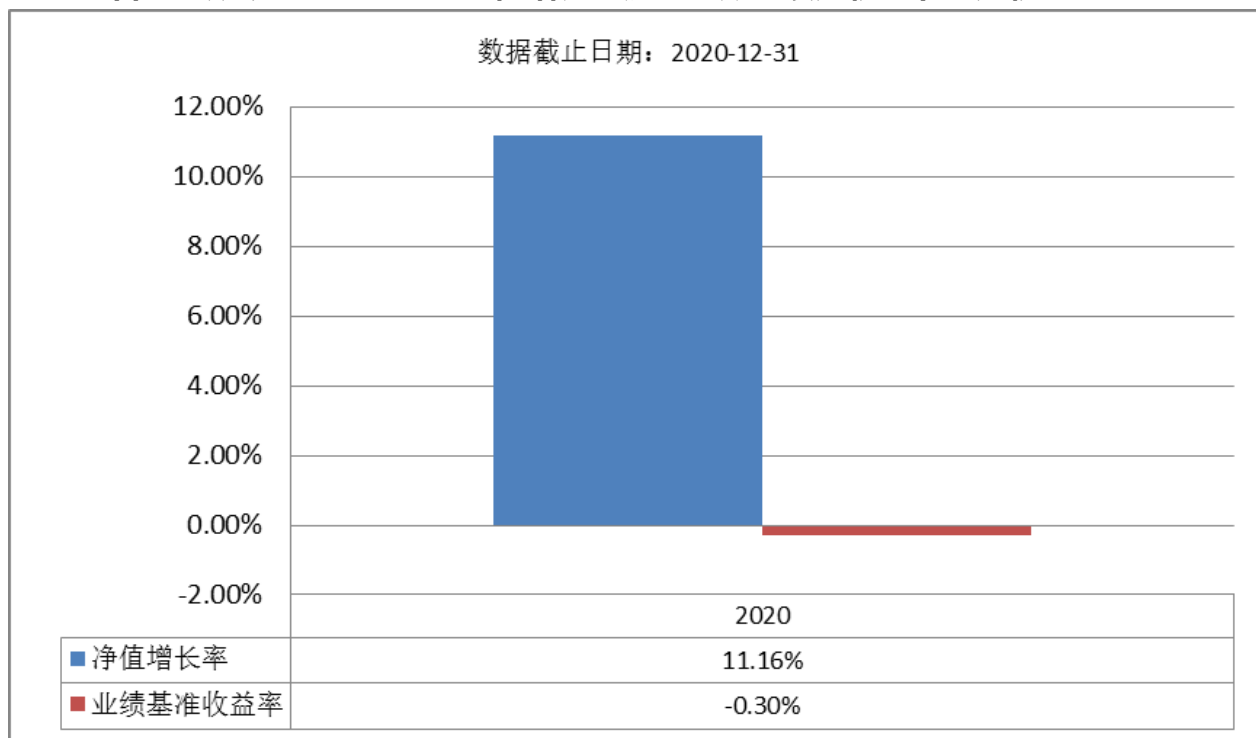
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表

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2020年09月03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

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	1.50%	

	100 万元 \leq M < 500 万元	0.60%	
	M \geq 500 万元	1000 元/笔	
赎回费	N < 7 天	1.50%	100%计入资产
	7 天 \leq N < 30 天	0.75%	100%计入资产
	30 天 \leq N < 60 天	0.50%	至少 75%计入资产
	N \geq 60 天	0.00%	

注：场内交易费用以证券公司实际收费为准。对于通过基金管理人直销渠道申购的养老金客户，享受申购费率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 1.50%
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；《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；基金上市费及年费；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等。

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、本基金的特定风险

（1）本基金为混合型证券投资基金，存在大类资产配置风险，有可能因为受到经济周期、市场环境或管理人能力等因素的影响，导致基金的大类资产配置比例偏离最优化水平，给基金投资组合的绩效带来风险。同时，本基金在股票投资方面投资于创业板注册制改革背景下，受益于传统产业与新技术、新产业、新业态、新模式深度融合的创业板相关股票，在个股投资决策中给基金带来一定的不确定性，因而存在个股选择风险。

（2）期货等金融衍生品投资风险

金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定

价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价、指数微小的变动就可能使投资者权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

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。

本基金参与股票期权交易以套期保值为主要目的，投资股票期权的主要风险包括价格波动风险、市场流动性风险、强制平仓风险、合约到期风险、行权失败风险、交易违约风险等。影响期权价格的因素较多，有时会出现价格较大波动，而且期权有到期日，不同的期权合约又有不同的到期日，若到期日当天没有做好行权准备，期权合约就会作废，不再有任何价值。此外，行权失败和交收违约也是股票期权交易可能出现的风险，期权义务方无法在较首日备齐足额资金或证券用于交收履约，会被判为交收违约并受罚，相应地，行权投资者就会面临行权失败而失去交易机会。

（3）资产支持证券投资风险

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。

（4）港股通机制下港股投资的风险

本基金投资范围包括港股通标的股票，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，本基金还会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

本基金港股通标的股票投资的比例下限为零。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

（5）投资创业板股票的风险

本基金投资范围包括在创业板上市公司股票，会因创业板发行、上市等业务规则与主板、中小企业板市场的相应规则不同而存在特有风险：

1) 创业板市场股票首次公开发行并上市的条件与主板市场存在较大差异。创业板上市公司一般处于发展初期，经营历史较短，规模较小，经营稳定性相对较低，抵抗市场和行业波动的能力相对较弱。此外，创业板上市公司使用的新技术的先进性与可靠性、新模式的适用性和成熟度、新行业的市场容量和成长空间都有较大不确定性，投资者对创业板市场上市公司高增长的预期并不一定会实现，风险较主板大。

2) 创业板上市公司退市制度设计更为严格，包括创业板不再实施“退市风险警示处理”措施；深交所设立“退市整理期”和“退市整理版”，对即将终止上市的创业板股票实行另板揭示，不再与其他股票一起显示行情；专门针对创业板股票新增五类退市场景，设置快速退市程序，缩短退市时间。因此与主板市场相比，可能导致创业板市场上市公司退市场景增加，退市速度加快，可能导致退市后无法继续交易该公司股票，造成损失。

3) 创业板上市公司流通股较少，股价波动相对更大，传统的估值判断方法可能无法完全适用，价值判断可能存在较大差异。

4) 创业板市场上市公司高科技转化为市场商品或劳务的实际效果具有不确定性，相关产品或技术更新换代快，存在出现技术失败而造成损失的风险。

本基金可根据实际需要，对投资创业板上市公司股票的标的和规模进行动态调整。

（6）本基金以定期开放的方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）两年的期间，本基金采取封闭运作模式，基金份额持有人不能赎回基金份额，因此，若基金份额持有人错过某一开放期而未能赎回，其份额可能将转入下一封闭

期，至下一开放期方可赎回。

本基金开放期内单个开放日出现巨额赎回的，基金管理人对符合法律法规及《基金合同》约定的赎回申请应于当日全部予以接受和确认。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金在单个开放日出现巨额赎回被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人仍有可能存在延缓支付赎回款项的风险，同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的，基金管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施，未赎回的基金份额持有人仍有可能承担短期内变现而带来的冲击成本对基金净资产产生的负面影响。

(7) 基金上市交易后，在本基金封闭期内，本基金份额持有人可以通过证券市场二级市场交易卖出基金份额变现。在证券市场持续下跌、基金二级市场交易不活跃等情形下，有可能出现本基金份额二级市场交易价格低于基金份额净值的情形，即基金折价交易，从而影响持有人收益或产生损失。

(8) 自动清算的风险

本基金基金合同生效后，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。

基金合同生效后，若登记机构完成每个开放期最后一个开放日的申购、赎回业务申请确认时，本基金的基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元，基金管理人在履行相关监管报告和信息披露程序后终止基金合同而无需召开基金份额持有人大会。本基金将根据基金合同第二十部分的约定进行基金财产清算。

因此本基金有面临自动清算的风险。

(9) 本基金可参与股票战略配售，除战略配售外的股票投资部分可以以中国证监会允许的其他方式进行投资。战略配售股票有可能出现股价波动较大的情况，投资者有可能面临战略配售股票价格大幅波动的风险。

(10) 本基金采用战略配售方式参与股票投资的部分，通常有一定限售期，因此，本基金部分股票投资面临限售期内标的无法交易的风险。

(11) 融资和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。

(12) 本基金认购的比例确认风险

本基金管理人可在募集期内实行限量销售，设定规模上限并采用末日比例确认的方式。若当日本基金达到规模上限，则该日投资人的认购申请存在部分确认的情况。

(13) 本基金封闭期内基金总资产可不超过基金净资产的 200%，可能造成本基金资产净值波动大于普通开放式基金的风险。

(14) 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。

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][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

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中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对双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职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。