# 关于博时中证银行指数分级证券投资基金之博时银行A份额和博时银行B份额终止运作的特别风险提示公告

根据《博时基金管理有限公司关于博时中证银行指数分级证券投资基金实施转型的公告》、《博时基金管理有限公司关于博时中证银行指数分级证券投资基金之博时银行A份额、博时银行B份额终止上市的公告》，博时中证银行指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之博时银行A份额（场内简称：银行A类，基金代码：150267）和博时银行B份额（场内简称：银行B类，基金代码：150268）的终止上市日为2020年8月4日（最后交易日为2020年8月3日），份额转换基准日为2020年8月4日。在份额转换基准日日终，以博时银行份额的基金份额净值为基准，博时银行A份额、博时银行B份额按照各自的基金份额参考净值折算成场内博时银行份额。

针对本基金之博时银行A份额和博时银行B份额终止运作的相关安排，基金管理人特别提示如下风险事项，敬请投资者关注：

1、转换基准日前（不含转换基准日），博时银行A份额和博时银行B份额仍可正常交易，期间敬请投资者高度关注以下风险：

（1）由于博时银行A份额和博时银行B份额可能存在折溢价交易情形，其折溢价率可能发生较大变化，**如果投资者以溢价买入，折算后可能遭受较大损失**（具体折算方式及示例详见本公告第4条）。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

投资者应密切关注博时银行A份额和博时银行B份额的基金份额

参考净值变化情况（可通过本公司网站查询）。

（2）博时银行A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征，但在份额折算后，博时银行A份额的持有人将持有具有较高预期风险、较高预期收益特征的博时银行份额，由于博时银行份额为跟踪中证银行指数的基础份额，其份额净值将随标的指数的涨跌而变化，**原博时银行A份额持有人将承担因市场下跌而遭受损失的风险。**

博时银行B份额具有一定的杠杆属性，具有高预期风险、预期收益相对较高的特征，但在份额折算后，博时银行B份额的持有人将持有具有较高预期风险、较高预期收益特征的博时银行份额，由于博时银行份额为跟踪中证银行指数的基础份额，没有杠杆特征，其基金份额净值将随标的指数的涨跌而变化，不会形成杠杆性收益或损失，但原博时银行B份额持有人仍需承担因市场下跌而遭受损失的风险。

2、博时银行A份额和博时银行B份额折算为博时银行份额前，博时银行A份额和博时银行B份额的持有人有两种方式退出：

（1）在场内按市价卖出基金份额；

（2）在场内买入等量的对应份额（即博时银行A份额持有人买入等量的博时银行B份额，或者博时银行B份额持有人买入等量的博时银行A份额），合并为博时银行份额，按照博时银行份额的基金份额净值申请场内赎回或转托管至场外后申请赎回。

3、由于博时银行A份额和博时银行B份额的持有人可能选择场内卖出或合并赎回，场内份额数量可能发生较大下降，可能出现场内流动性不足的情况，**特提请投资者注意流动性风险。**

4、在份额转换基准日日终，以博时银行份额的基金份额净值为基准，博时银行A份额、博时银行B份额按照各自的**基金份额参考净值（而不是二级市场价格）**折算成场内博时银行份额。博时银行A份额和博时银行B份额基金份额持有人持有的折算后场内博时银行份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金资产。

**折算前存在溢价交易的基金份额的持有人将会因为溢价的消失而造成损失。**

**博时银行A份额和博时银行B份额的基金份额持有人持有的基金份额数量将会在折算后发生变化，**示例如下：

**假设份额转换基准日博时银行份额、博时银行A份额和博时银行B份额的基金份额（参考）净值的分别为：0.900元、1.010元、0.790元，**投资者甲、乙、丙分别持有场内博时银行份额、博时银行A份额、博时银行B份额各100,000份，其所持基金份额的变化如下表所示：

| | 折算前 | | 份额折算比例 | 折算后 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 基金份额（参考）净值（元） | 基金份额（份） | | 基金份额净值（元） | 基金份额 |
| 博时银行份额 | 0.900 | 100,000 | （无变化） | 0.900 | 100,000份场内博时银行份额 |
| 博时银行A份额 | 1.010 | 100,000 | 1.122222222（全部折算为博时银行份额） | 0.900 | 112,222份场内博时银行份额 |
| 博时银行B份额 | 0.790 | 100,000 | 0.877777778（全部折算为博时银行份额） | 0.900 | 87,777份场内博时银行份额 |

5、**博时银行A份额和博时银行B份额折算为博时银行份额后，**

投资者可以申请场内赎回基金份额或者转托管至场外后申请赎回基金份额。对于**无法办理场内赎回的投资者，需先转托管至场外后方可申请赎回**。

6、根据中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则，博时银行A份额和博时银行B份额合并或折算为博时银行份额后，**基金份额持有期自博时银行份额确认之日起重新计算**。

本基金转型后的赎回费率如下：

（1）场外赎回费率

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费率随基金份额持有时间增加而递减，具体如下：

| 持有时间（T） | 赎回费率 |
| --- | --- |
| Y＜7 日 | 1.50% |
| 7 日≤Y＜1 月 | 0.10% |
| Y≥1 月 | 0.00% |

注：1 个月指 30 日

（2）场内赎回费率

**本基金的场内赎回费率为 7 日内 1.50%，7 日及以上 0.10%。**

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。向持有期限少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，向持有期限大于等于 7 日的投资者收取的不低于赎回费总额的 25%计入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要

的手续费。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资有风险，敬请投资者认真阅读相关公告，了解本基金目前的风险收益特征变化和相关安排，并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况谨慎作出投资决策。

如有疑问，请拨打博时一线通：95105568（免长途话费）或登录本公司网站 www.bosera.com 获取相关信息。

特此公告。

博时基金管理有限公司

2020 年 8 月 3 日