

博时中证银行指数分级证券投资基金

办理定期份额折算业务的公告

根据《博时中证银行指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）的相关规定，博时中证银行指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将以 2019 年 12 月 2 日为基金份额折算基准日办理定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定，定期折算基准日为本基金存续期内每个会计年度 12 月份的第一个工作日。本次定期份额折算基准日为 2019 年 12 月 2 日。

二、基金份额折算对象

基金份额定期折算基准日登记在册的博时银行份额（场内简称：博时银行，基金代码：160517）和博时银行 A 份额（场内简称：银行 A 类，基金代码：150267）；博时银行 B 份额（场内简称：银行 B 类，基金代码：150268）不参与定期折算。

三、基金份额折算方式

博时银行 A 份额和博时银行 B 份额按照本基金基金合同中规定的参考净值计算规则进行净值计算，对博时银行 A 份额的约定应得收益进行定期份额折算，每 2 份博时银行份额将按 1 份博时银行 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，博时银行 A 份额和博时银行 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例不变。

折算过程如下：根据净资产不变的原则，将博时银行 A 份额每个会计年度定期折算基准日折算前的份额参考净值超过 1.0000 元的部分转换成博时银行场内份额；博时银行份额持有人所持有的每两份博时银行份额按照一份博时银行 A 份额获得新增博时银行份额的分配，按上述份额折算后，博时银行 A 份额的基金份额参考净值和博时银行份额的基金份额净值作相应的调整，博时银行 B 份额不进行折算。

1、博时银行份额之折算

（1）定期折算后的博时银行份额净值

$$NAV_{\text{银行}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前博时银行份额的资产净值} - \frac{1}{2} (NAV_A^{\text{前}} - 1.0000) \times NUM_{\text{银行}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{银行}}^{\text{前}}}$$

其中， $NAV_{\text{银行}}^{\text{后}}$ 为折算基准日折算后博时银行份额的基金份额净值。 $NAV_A^{\text{前}}$ 为折算基

准日折算前博时银行 A 份额的份额参考净值。 $NUM_{\text{银行}}^{\text{前}}$ 为折算基准日折算前博时银行份额的份额数。

(2) 定期折算后的博时银行份额数

定期份额折算后原博时银行份额持有人持有的博时银行份额的份额数 = 定期份额折算前博时银行份额的份额数 + 博时银行份额持有人新增的博时银行份额的份额数

$$\text{博时银行份额持有人新增的博时银行份额} = \frac{(NAV_A^{\text{前}} - 1.0000)}{NAV_{\text{银行}}^{\text{后}}} \times \frac{NUM_{\text{银行}}^{\text{前}}}{2}$$

其中 $NUM_{\text{银行}}^{\text{前}}$ 为折算前博时银行的份额数

2、博时银行 A 份额之折算

定期折算时,博时银行 A 份额折算后份额数保持不变,基金份额参考净值折算为 1.0000 元,折算前博时银行 A 份额参考净值超出 1.0000 元部分折算为场内博时银行份额;计算方式为:

定期份额折算后博时银行 A 份额的份额数 = 定期份额折算前博时银行 A 份额的份额数

$$\text{博时银行 A 份额持有人新增的场内博时银行份额数量} = \frac{(NAV_A^{\text{前}} - 1.0000) \times NUM_A^{\text{前}}}{NAV_{\text{银行}}^{\text{后}}}$$

其中 $NUM_A^{\text{前}}$ 为折算前博时银行 A 的份额数

3、博时银行 B 不进行定期折算

定期份额折算不改变博时银行 B 份额参考净值及其份额数。定期折算完成时,场外博时银行份额采用截位法保留到小数点后第 2 位,小数点第 3 位及第 3 位以后的部分舍去;场内博时银行份额采用截位法保留到整数位;由上述截位法计算过程产生的余额计入基金财产。

四、基金份额折算期间的基金业务办理

1、定期份额折算基准日(即 2019 年 12 月 2 日),本基金暂停办理申购(含定期定额投资,下同)、赎回、转托管(包括系统内转托管和跨系统转托管,下同)及配对转换业务;博时银行 A 份额(场内简称:银行 A 类,基金代码:150267)、博时银行 B 份额(场内简称:银行 B 类,基金代码:150268)正常交易。当日晚间,基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

2、定期份额折算基准日后的第一个工作日(即 2019 年 12 月 3 日),本基金暂停办理申购、赎回、转托管及配对转换业务,博时银行 A 份额暂停交易,博时银行 B 份额正常交

易。当日，本基金注册登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

3、定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2019 年 12 月 4 日），基金管理人、将公告份额折算确认结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，本基金恢复办理申购、赎回、转托管及配对转换业务，博时银行 A 份额、博时银行 B 份额正常交易。

五、重要提示

1、根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2019 年 12 月 4 日银行 A 级即时行情显示的前收盘价为 2019 年 12 月 3 日的博时银行 A 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。由于博时银行 A 份额折算前可能存在折溢价交易情形，折算前的收盘价扣除约定收益后与 2019 年 12 月 4 日的前收盘价可能有较大差异，因此 2019 年 12 月 4 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

2、本基金博时银行 A 份额期末的约定应得收益将折算为场内博时银行份额分配给博时银行 A 份额的持有人，而博时银行份额为跟踪中证银行指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此博时银行 A 份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性，其可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、由于博时银行 A 份额经折算产生的新增场内博时银行份额数和场内博时银行份额经折算后的份额数将取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产，持有极小数量博时银行 A 份额或场内博时银行份额的持有人存在无法获得新增场内博时银行份额的可能性。

4、投资者若希望了解基金定期份额折算业务详情，请登陆本公司网站：www.bosera.com，或者拨打本公司客服电话：95105568（免长途话费）。

风险提示：

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。本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。投资有风险，决策须谨慎。

特此公告。

博时基金管理有限公司

2019 年 11 月 27 日