

博时中证 800 证券保险指数分级证券投资基金可能发 生不定期份额折算的风险提示公告

根据《博时中证 800 证券保险指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）中关于不定期份额折算的相关规定，当博时证保份额净值大于等于 1.5000 元时，博时中证 800 证券保险份额（代码：160516，场内简称：博时证保，基础份额）、博时证保 A 份额（代码：160225，场内简称：证保 A 级）、博时证保 B 份额（代码：160226，场内简称：证保 B 级）将进行不定期份额折算。

由于近期本基金跟踪标的指数上涨，截至 2020 年 7 月 20 日，博时证保的基金份额参考净值接近基金合同规定的不定期份额折算的阈值 1.5000，因此本基金管理人敬请投资者密切关注博时证保近期的参考净值波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

一、证保 B 级表现为预期风险高、预期收益高的特征，当发生合同规定的上述不定期份额折算时，证保 B 级份额的基金份额参考净值超过 1.000 元的部分将会折算为证保 B 级份额和博时证保份额，证保 B 级份额参考净值将变为 1.000 元。即原证保 B 级份额的持有人在不定期份额折算后将持有证保 B 级份额和博时证保份额。因此，持有人的风险收益特征将发生一定的变化，由持有单一的高风险收益特征份额变为同时持有高风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况。

二、当发生合同规定的上述不定期份额折算时，博时证保份额、证保 A 级份额参考净值将变为 1.0000 元，博时证保份额、证保 A 级份额数将相应调整，即份额折算前持有人持有的博时证保份额、博时证保 A 份额的资产净值与份额折算后博时证保份额、博时证保 A 份额的资产净值相等。

三、由于证保 A 级、证保 B 级折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，证保 A 级、证保 B 级的折溢价率可能发生较大变化。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。

四、由于触发折算阈值当日，博时证保的净值可能已高于阈值，而折算基准日在触发阈值日后才能确定，此折算基准日博时证保的净值可能与折算阈值 1.5000 元有一定差异。

本基金管理人的其他重要提示：

一、根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金资产，持有极小数量博时证保份额、博时证保 A 级份额、博时证保 B 级份额的持有人存在折算后份额因为不足 1 份而被强制归入基金资产的风险。

二、为保证折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停证保 A 级与证保 B 级的上市交易和博时证保份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅本基金的基金合同及《博时中证 800 证券保险指数分级证券投资基金招募说明书》（更新）（以下简称“招募说明书”）或者拨打本公司客服电话：95105568（免长途话费）。

三、本基金管理人已于 2020 年 5 月 22 日发布公告，自 2020 年 5 月 26 日起暂停博时证保份额的场内分拆业务。

四、本基金将于 2020 年 8 月 7 日正式转型为“博时中证全指证券公司指数证券投资基金”，敬请投资者留意。转型后，博时证券保险指数分级份额的场内份额和场外份额将分别自动转换成博时中证全指证券公司指数证券投资基金基金份额的场内份额和场外份额，不再设置基金份额的分级、折算、配对转换等机制。投资标的指数由中证 800 证券保险指数变更为中证全指证券公司指数。其他详细情况请见基金管理人 2020 年 5 月 21 日发布的《博时中证 800 证券保险指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会公告》。

五、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，选择须谨慎。敬请投资者于投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

特此公告。

博时基金管理有限公司

2020 年 7 月 21 日