

关于博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金申购业务结算模式调整并于 2021 年 7 月 23 日暂停申购赎回业务的公告

公告送出日期：2021 年 7 月 21 日

根据中国证券登记结算有限责任公司近期披露的《关于修订<中国证券登记结算有限责任公司上海分公司交易型开放式基金登记结算业务指南>的通知》(以下简称“《通知》”),为进一步提升结算效率,自 2021 年 7 月 26 日起,博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(基金代码:513500,基金简称:标普 500,扩位基金简称:标普 500ETF,以下简称“本基金”)申购业务的结算模式调整为实时逐笔全额结算(Real Time Gross Settlement),相关调整涉及基金合同及招募说明书条款修改。为完成相关调整,2021 年 7 月 23 日本基金暂停申购、赎回业务。现公告说明如下:

一、 暂停申购、赎回业务时间

根据《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的相关规定,因申购业务结算模式调整,本基金管理人决定于 2021 年 7 月 23 日暂停本基金的申购、赎回业务,并自 2021 年 7 月 26 日起恢复本基金的上述业务,届时不再另行公告。

二、 调整要点说明

根据《通知》,自 2021 年 7 月 26 日起,本基金申购和赎回申请的确认、申购和赎回的清算交收与登记、申购对价中退补现金替代金额的处理程序以及赎回对价中现金替代的处理程序相应调整如下:

(一) 申购与赎回申请的确认

投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资人未能提供符合要求的申购对价,则申购申请失败。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金,则赎回申请失败。投资者申购的基金份额,清算交收完成后方可卖出和赎回。

(二) 申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购业务采用实时逐笔全额结算(Real Time Gross Settlement)模

式；赎回业务涉及的现金替代可采用代收代付处理；申购、赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款可采用代收代付处理。

1、申购的清算交收与登记

投资者 T 日申购申请受理后，如交易记录已勾单且申购资金足额的，登记结算机构在 T 日日间实时办理基金份额及现金替代的交收；T 日日间未进行勾单确认或日间资金不足的，登记结算机构在 T 日日终根据资金是否足额办理基金份额及现金替代的清算交收，并将结果发送给基金管理人、申购赎回代理券商和基金托管人。登记结算机构在 T+2 日内办理现金差额的清算，在 T+3 日内办理现金差额的交收。

2、赎回的清算交收与登记

投资人 T 日赎回成功后，正常情况下，登记结算机构在 T 日收市后为投资人办理基金份额的交收，在 T+2 日办理现金差额的清算，并将清算结果发送给基金管理人、基金托管人及相关申购赎回代理券商。基金管理人与申购赎回代理券商在 T+3 日办理现金差额的交收。赎回现金替代款将自有效赎回申请之日起 10 个工作日内划往基金份额持有人账户。

（三）申购对价中退补现金替代金额的处理程序

T 日，基金管理人在申购、赎回清单中公布申购现金替代溢价比例，并据此收取退补现金替代金额。

对于确认成功的 T 日的申购申请，基金管理人将在 T 日，买入被替代的成份证券。T 日日终，若基金管理人已买入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际买入成本（包括买入价格与交易费用）按照汇率折算后的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项；若基金管理人未能买入全部被替代的证券，则以替代金额与所买入的部分被替代证券实际买入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照 T 日收盘价（被替代证券 T 日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价）计算的未买入部分的被替代证券价值按照汇率折算后的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。

若 T 日被替代的证券发生除息、送股（转增）、配股重要权益变动，则进行相应调整。

T 日后的第 4 个上海证券交易所和美国主要证券交易所的共同交易日内，基

金管理人与相关申购赎回代理券商办理现金替代退补款的交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

（四）赎回对价中现金替代的处理程序

对于确认成功的 T 日的赎回申请，基金管理人将在 T 日卖出相应的成份证券。

T 日日终，若基金管理人已卖出全部被替代的成份证券，则以实际卖出所得（卖出价格扣减相应的交易费用）按照汇率折算后的差额，确定基金应交付给投资人的赎回现金替代金额；若基金管理人未能卖出全部被替代的成份证券，则以实际卖出所得（卖出价格扣减相应的交易费用）加上按照 T 日收盘价（被替代证券 T 日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价）计算的未卖出部分被替代成份证券价值，按照汇率折算后的金额，确定基金应交付给投资人的赎回现金替代金额。

若 T 日被替代的证券发生除息、送股（转增）、配股重要权益变动，则进行相应调整。

T 日后的第 6 个上海证券交易所和美国主要证券交易所的共同交易日内，基金管理人将与相关申购赎回代理券商办理赎回现金替代金额的交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

三、 基金法律文件修订情况

本次调整涉及本基金基金合同及招募说明书的修订，修订前后对照表详见附件。

四、 重要提示

本次修改系根据登记机构的相关业务规则变动而进行的修改，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，不需要召开基金份额持有人大会。修改后的基金合同及招募说明书自 2021 年 7 月 26 日起生效，基金管理人已履行了规定程序，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。修改后的基金合同及相应更新的招募说明书将与本公告同日登载于基金管理人网站（www.bosera.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）。

五、 其他事项

1、投资者可通过以下途径咨询有关详情

(1) 本公司客户服务电话：95105568（全国免长途话费）；

(2) 本公司网址：<http://www.bosera.com>。

2. 风险提示：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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书和基金产品资料概要等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。

特此公告。

博时基金管理有限公司

2021 年 7 月 21 日

附：

一、基金合同修订前后对照表

章节	修订前	修订后
全文	《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》	<u>《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》及其不时修订</u>
第 八 部 分 基 金 份 额 的 申 购 与 赎 回	三、申购与赎回的原则	三、申购与赎回的原则
	4、申购、赎回应遵守 《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》 的规定。	4、申购、赎回应遵守 <u>业务规则</u> 的规定。
	四、申购与赎回的程序	四、申购与赎回的程序
	2、申购和赎回申请的确认	2、申购和赎回申请的确认
	投资人 T日的申购、赎回申请由登记结算机构在T+1日进行确认。如投资人未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，则赎回申请失败。	<u>本基金</u> T日的申购、赎回申请的确认根据登记结算机构的相关规定办理， <u>具体见本基金招募说明书</u> 。如投资人未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，则赎回申请失败。
	3、申购和赎回的清算交收与登记	3、申购和赎回的清算交收与登记
	本基金 申购赎回过程中涉及的现金和基金份额交收适用《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式指数基金登记	<u>本基金</u> 申购赎回过程中涉及的基金份额、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用相关业务规则和参与各方相关协议及其不时修订

结算业务实施细则》。 （1）、申购的清算交收与登记 投资人T日申购成功后，正常情况下，登记结算机构在T+1日收市后办理基金份额和现金替代等的交收，在T+2日办理现金差额的清算，并将清算结果发送给基金管理人、基金托管人和申购赎回代理券商。基金管理人于申购赎回代理券商在T+3日办理现金差额的交收。 （2）、赎回的清算交收与登记 投资人T日赎回成功后，正常情况下，登记结算机构在T+1日收市后为投资人办理基金份额的交收，在T+2日办理现金差额的清算，并将清算结果发送给基金管理人、基金托管人及相关申购赎回代理券商。基金管理人于申购赎回代理券商在T+3日办理现金差额的交收。赎回现金替代款将自有效赎回申请之日起10个工作日内划往基金份额持有人账户。 如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。若发生特殊情况，	的有关规定，详见本基金招募说明书及其更新。 如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据<u>上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则和参与各方相关协议及其不时修订</u>的有关规定进行处理。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。
---	--

	基金管理人可以对交收日期进行相应调整。	
--	---------------------	--

二、招募说明书修订前后对照表

章节	修订前	修订后
全文	《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》	<u>《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》及其不时修订</u>
重 要 提 示	本基金为投资美国市场的 ETF，基金份额的清算交收和境内普通 ETF 存在一定差异，通常情况下，投资人当日申购的基金份额，清算交收完成后方可卖出和赎回， 即 T 日申购的基金份额，T 日日终交收完成的当日可以卖出和赎回，T 日日终交收完成的 T+1 日方可卖出和赎回在 T+2 日才可以卖出或赎回。	本基金为投资美国市场的 ETF，基金份额的清算交收和境内普通 ETF 存在一定差异，通常情况下，投资人当日申购的基金份额，清算交收完成后方可卖出和赎回。
第 十 部 分 基 金 份 额 的 申 购 与 赎 回	四、申购与赎回的原则 4、申购、赎回应遵守 《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》 的规定。	四、申购与赎回的原则 4、申购、赎回应遵守 <u>业务规则</u> 的规定。
	五、申购与赎回的程序 2、申购和赎回申请的确认 投资人 T 日的申购、赎回申请由登记结算机构在 T+1 日进行确认。如	五、申购与赎回的程序 2、申购和赎回申请的确认 <u>投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。</u> 如投资人未能提供符合

投资人未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，则赎回申请失败。 3、申购和赎回的清算交收与登记 本基金申购赎回过程中涉及的现金和基金份额交收适用《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》。 (1)、申购的清算交收与登记 投资人 T 日申购成功后，正常情况下，登记结算机构在 T+1 日收市后办理基金份额和现金替代等的交收，在 T+2 日办理现金差额的清算，并将清算结果发送给基金管理人、基金托管人和申购赎回代理券商。基金管理人于申购赎回代理券商在 T+3 日办理现金差额的交收。	要求的申购对价，则申购申请失败。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，则赎回申请失败。<u>投资者申购的基金份额，清算交收完成后方可卖出和赎回。</u> 3、申购和赎回的清算交收与登记 <u>本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用相关业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定。</u> <u>本基金申购业务采用实时逐笔全额结算（Real Time Gross Settlement）模式；赎回业务涉及的现金替代可采用代收代付处理；申购、赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款可采用代收代付处理。</u> (1)、申购的清算交收与登记 <u>投资者 T 日申购申请受理后，如交易记录已勾单且申购资金足额的，登记结算机构在 T 日日间实时办理基金份额及现金替代的交收；T 日日间未进行勾单确认或日间资金不足的，登记结算机构在 T 日日终根据资金是否足额办理基金份额及现金替代的清算交收，并将结果发送给基金管理人、申购赎回代理券商和基金托管人。登记结算机构在 T+2</u>
---	--

	(2)、赎回的清算交收与登记 投资人 T 日赎回成功后, 正常情况下, 登记结算机构在 T+1 日收市后为投资人办理基金份额的交收, 在 T+2 日办理现金差额的清算, 并将清算结果发送给基金管理人、基金托管人及相关申购赎回代理券商。基金管理人于申购赎回代理券商在 T+3 日办理现金差额的交收。赎回现金替代款将自有效赎回申请之日起 10 个工作日内划往基金份额持有人账户。 外管局相关规定有变更或本基金境外投资主要市场的交易清算规则有变更时, 申购赎回现金替代款支付时间将相应调整。当基金境外投资主要市场休市或暂停交易时, 赎回现金替代款支付的时间顺延。 如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形, 则依据《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。若发生特殊情况, 基金管理人可以对交收日期进行相应调整。	<u>日内办理现金差额的清算, 在 T+3 日内办理现金差额的交收。</u> (2)、赎回的清算交收与登记 投资人 T 日赎回成功后, 正常情况下, 登记结算机构在 T 日收市后为投资人办理基金份额的交收, 在 T+2 日办理现金差额的清算, 并将清算结果发送给基金管理人、基金托管人及相关申购赎回代理券商。基金管理人于申购赎回代理券商在 T+3 日办理现金差额的交收。赎回现金替代款将自有效赎回申请之日起 10 个工作日内划往基金份额持有人账户。 外管局相关规定有变更或本基金境外投资主要市场的交易清算规则有变更时, 申购赎回现金替代款支付时间将相应调整。当基金境外投资主要市场休市或暂停交易时, 赎回现金替代款支付的时间顺延。 如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形, 则依据<u>《上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则和参与各方相关协议及其不时修订》</u>的有关规定进行处理。若发生特殊情况, 基金管理人可以对交收日期进行相应调整。
	八、申购赎回清单的内容与格式 F. 申购对价中退补现金替代金额的处理程序	八、申购赎回清单的内容与格式 F. 申购对价中退补现金替代金额的处理程序

本部分“T+1日”指T日后的第1个上海证券交易所和美国主要证券交易所的共同交易日。 T日，基金管理人在申购、赎回清单中公布申购现金替代溢价比例，并据此收取退补现金替代金额。 对于确认成功的T日的申购申请，基金管理人将在T+1日，买入被替代的成份证券。T+1日日终，若基金管理人已买入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际买入成本（包括买入价格与交易费用）按照汇率折算后的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项；若基金管理人未能买入全部被替代的证券，则以替代金额与所买入的部分被替代证券实际买入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照T+1日收盘价（被替代证券T+1日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价）计算的未买入部分的被替代证券价值按照汇率折算后的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。 若T日后至T+1日期间被替代的证券发生除息、送股（转增）、配股重要权益变动，则进行相应调整。 T+1日后的第3个上海证券交易所和美国主要证券交易所的共同交易日，基金管理人与相关申购赎回代理券商办理现金替代退补款的交收。	T日，基金管理人在申购、赎回清单中公布申购现金替代溢价比例，并据此收取退补现金替代金额。 对于确认成功的T日的申购申请，基金管理人将在T日，买入被替代的成份证券。T日日终，若基金管理人已买入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际买入成本（包括买入价格与交易费用）按照汇率折算后的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项；若基金管理人未能买入全部被替代的证券，则以替代金额与所买入的部分被替代证券实际买入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照T日收盘价（被替代证券T日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价）计算的未买入部分的被替代证券价值按照汇率折算后的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。 若T日被替代的证券发生除息、送股（转增）、配股重要权益变动，则进行相应调整。 T日后的第3第4个上海证券交易所和美国主要证券交易所的共同交易日内，基金管理人与相关申购赎回代理券商办理现金替代退补款的交收。
--	--

若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。 G. 赎回对价中现金替代的处理程序 本部分“T+1日”指T日后的第1个上海证券交易所和美国主要证券交易所的共同交易日。 对于确认成功的T日的赎回申请，基金管理人将在T+1日卖出相应的成份证券。 T+1日日终，若基金管理人已卖出全部被替代的成份证券，则以实际卖出所得（卖出价格扣减相应的交易费用）按照汇率折算后的差额，确定基金应交付给投资人的赎回现金替代金额；若基金管理人未能卖出全部被替代的成份证券，则以实际卖出所得（卖出价格扣减相应的交易费用）加上按照T+1日收盘价（被替代证券T+1日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价）计算的未卖出部分被替代成份证券价值，按照汇率折算后的金额，确定基金应交付给投资人的赎回现金替代金额。 若T日后至T+1日期间被替代的证券发生除息、送股（转增）、配股重要权益变动，则进行相应调整。	若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。 G. 赎回对价中现金替代的处理程序 对于确认成功的T日的赎回申请，基金管理人将在T日卖出相应的成份证券。 T日日终，若基金管理人已卖出全部被替代的成份证券，则以实际卖出所得（卖出价格扣减相应的交易费用）按照汇率折算后的差额，确定基金应交付给投资人的赎回现金替代金额；若基金管理人未能卖出全部被替代的成份证券，则以实际卖出所得（卖出价格扣减相应的交易费用）加上按照T日收盘价（被替代证券T日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价）计算的未卖出部分被替代成份证券价值，按照汇率折算后的金额，确定基金应交付给投资人的赎回现金替代金额。 若T日被替代的证券发生除息、送股（转增）、配股重要权益变动，则进行相应调整。
---	--

	T+1日后的第5个上海证券交易所和美国主要证券交易日的共同交易日，基金管理人与相关申购赎回代理券商办理赎回现金替代金额的交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。	T日后的<u>第6</u>个上海证券交易所和美国主要证券交易日的共同交易日内，基金管理人与相关申购赎回代理券商办理赎回现金替代金额的交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。
--	---	---