

# 博时纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月25日

送出日期：2024年6月26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    | 博时纳斯达克 100ETF                                                                                                         | 基金代码           | 513390             |
| 基金管理人   | 博时基金管理有限公司                                                                                                            | 基金托管人          | 中信银行股份有限公司         |
| 境外投资顾问  | 无                                                                                                                     | 境外托管人          | 布朗兄弟哈里曼银行          |
| 基金合同生效日 | 2023-04-19                                                                                                            | 上市交易所及上市日期     | 上海证券交易所 2023-05-08 |
| 基金类型    | 股票型                                                                                                                   | 交易币种           | 人民币                |
| 运作方式    | 普通开放式                                                                                                                 | 开放频率           | 每个开放日              |
| 基金经理    | 万琼                                                                                                                    | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023-04-19         |
|         |                                                                                                                       | 证券从业日期         | 2007-03-01         |
| 场内简称    | 纳指基金                                                                                                                  |                |                    |
| 扩位简称    | 纳指 100ETF                                                                                                             |                |                    |
| 其他概况    | 《基金合同》生效后，连续 50 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，基金管理人应及时通知基金托管人，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。 |                |                    |

## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

敬请投资者阅读更新的《招募说明书》第四章了解详细情况

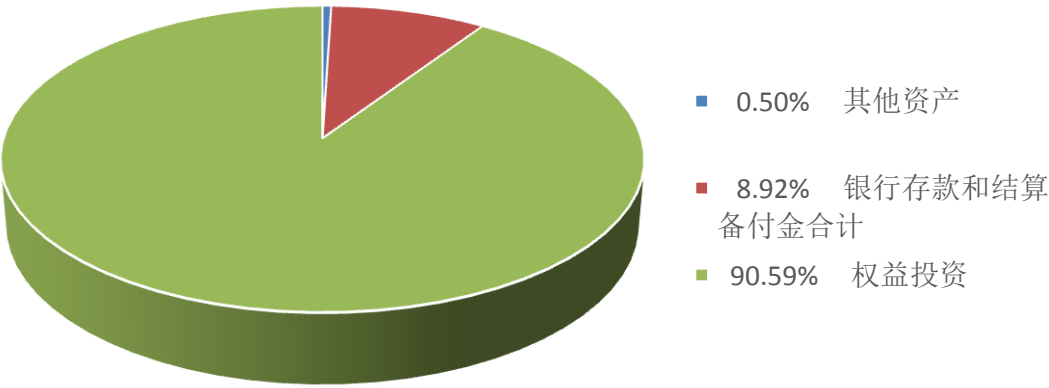
|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 投资范围 | 本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。<br>为更好地实现投资目标，本基金还可投资于境外市场和境内市场依法发行的金融工具，其中境外市场投资工具包括在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF)；依法发行上市的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”）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证（包括全球存托凭证、美国存托凭证等）、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、 |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的期权、期货等金融衍生产品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；其中在投资香港市场时，本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。</p> <p>境内市场投资工具包括国内依法发行或上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、中国存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、国债期货、股指期货、股票期权、货币市场工具（包括银行存款、同业存单等）、债券回购、资产支持证券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）。</p> <p>本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。未来在法律法规允许的前提下，本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人可以将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。</p> <p>本基金投资标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）的资产不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。</p> <p>如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例会做相应调整。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于0.20%，预期年化跟踪误差不超过2%。本基金的其他投资策略包括债券和货币市场工具投资策略、金融衍生品投资策略、融资及转融通证券出借策略、流通受限证券投资策略、资产支持证券的投资策略、非成份股的股票投资策略、存托凭证投资策略。</p> <p>未来，随着投资工具的发展和丰富，本基金可在不改变投资目标的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明更新中公告。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 业绩比较基准 | <p>纳斯达克100指数收益率（经估值汇率调整）</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 风险收益特征 | <p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪纳斯达克100指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。此外，本基金投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的风险。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

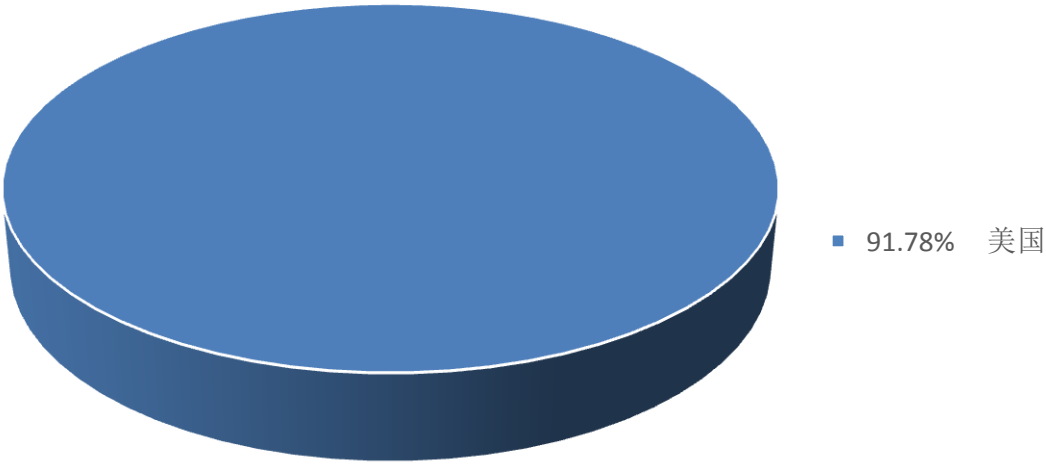
投资组合资产配置图表

数据截止日期：2024-03-31

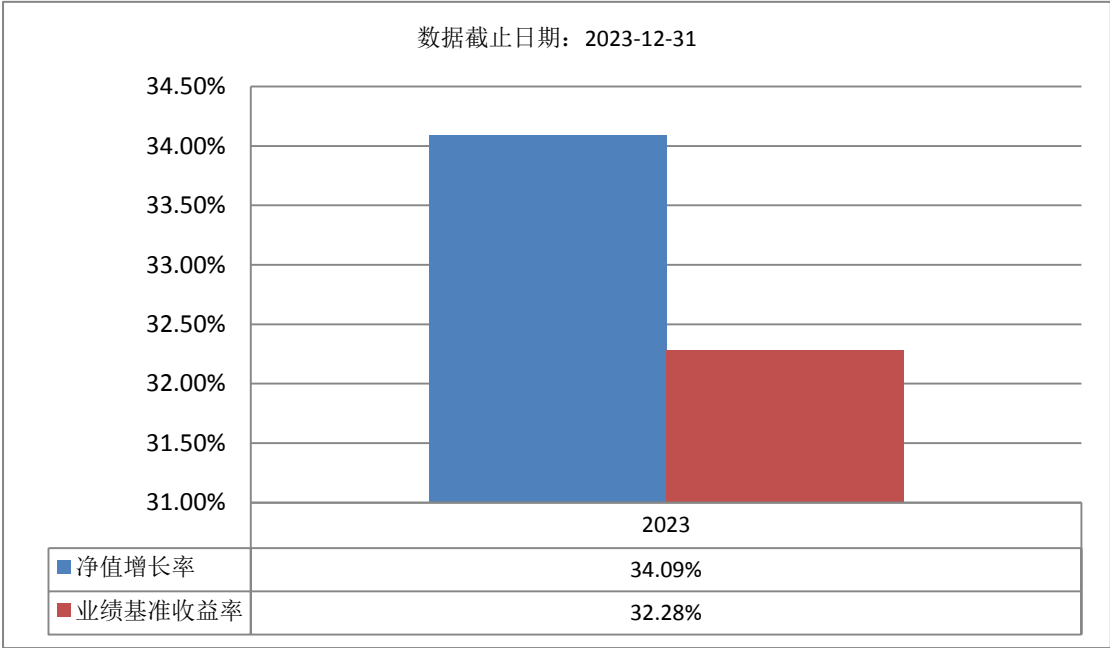


区域配置图表

数据截止日期：2024-03-31



(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

场内交易费用以证券公司实际收费为准。

申购费：

投资人在申购基金份额时，申购代理券商可按照不超过 0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

赎回费：

投资人在赎回基金份额时，赎回代理券商可按照不超过 0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

（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/年费率或金额                                             | 收取方               |
|-------|---------------------------------------------------------|-------------------|
| 管理费   | 固定比例 0.50%                                              | 基金管理人、销售机构、投资顾问机构 |
| 托管费   | 固定比例 0.15%                                              | 基金托管人             |
| 审计费用  | 38,000.00                                               | 会计师事务所            |
| 信息披露费 | 120,000.00                                              | 规定披露报刊            |
| 其他费用  | 基金合同生效后与本基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用等，详见招募说明书或其更新“基金的费用与税收”章节。 |                   |

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。  
2、本基金运作相关费用年金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

|  |              |
|--|--------------|
|  | 基金运作综合费率（年化） |
|--|--------------|

|          |       |
|----------|-------|
| 基金运作综合费率 | 0.74% |
|----------|-------|

注：基金管理费率、托管费率为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

## 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。

投资于本基金的主要风险包括：

#### 一、本基金特有的风险

##### 1、以 ETF 方式运作的特有风险

###### （1）投资于境外市场并以 ETF 方式运作的风险

本基金为境内募集和上市交易、投资于境外证券市场、跟踪特定指数的交易型开放式指数基金，涉及到境外证券市场，境外证券交易所、期货交易所、证券与期货登记机构的交易规则、业务规则和市场惯例与境内有较大差异，相关市场参与主体涉及跨境业务的处理能力、经验、系统等有待验证，从而导致本基金的运作可能受到影响而带来风险。

###### （2）指数化投资的风险

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）的资产不低于基金资产的 90%且不低于非现金基金资产净值的 80%，业绩表现将会随着标的指数的波动而波动；同时本基金在多数情况下将维持较高的股票仓位，在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

（3）标的指数的风险，包括标的指数变更的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险等风险。

（4）指数编制机构停止服务的风险。本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。因此，投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

###### （5）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

（6）跟踪误差控制未达约定目标的风险。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.20%，预期年化跟踪误差不超过 2%，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

（7）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险。基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，可能存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

（8）基金份额二级市场的流动性风险。若 ETF 基金一级市场申购赎回不活跃，会影响到 ETF 二级市场的流动性。当出现异常情况或事件，基金巨额申购赎回时，本基金二级市场的流动性均将受到较大的影响，从而带来投资风险。本基金二级市场交易不活跃还可能是出于以下原因：基金标的指数股票在境外市场交易，而基金份额则是在上海证券交易所交易，存在交易制度、节假日休市制度等的差异等。对 ETF 基金投资者而言，ETF 可在二级市场进行买卖，因此也可能面临因市场交易量不足而造成的流动性问题，带来基金在二级市场的流动性风险。基金的交易可能因各种原因被暂停，当基金不再符合相关上市条件时，基金的上市也可能被终止。

###### （9）成份股停牌的风险。标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，面临相应风险。

（10）成份股退市的风险。标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。

###### （11）退市风险。因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止

上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

(12) 申购及赎回风险。包括投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、基金赎回对价的变现风险等风险。

(13) 基金份额参考净值决策和基金份额参考净值计算错误的风险。基金管理人委托的机构在开市后根据基金管理人提供的申购赎回清单和汇率公允价，计算并发布基金份额参考净值，供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。基金份额参考净值与实时的基金份额净值可能存在差异，基金份额参考净值计算还可能出现错误，投资人若参考基金份额参考净值进行投资决策可能导致损失，该风险需投资人自行承担。

## 2、境外投资风险

(1) 海外市场风险。本基金投资于海外市场，面临海外市场波动带来的风险。影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等，都将影响基金净值的涨跌。此外，基金主要投资的海外证券市场可能对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此对于无涨跌幅上下限的规定证券市场的证券，每日涨跌幅空间相对较大。这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而带来投资风险的增加。

(2) 政府管制风险。在特殊情况下，基金所投资市场有可能面临政府管制措施，包括对货币兑换进行限制、限制资本外流、征收高额税收等，会对基金投资造成影响。

(3) 监管风险。由于监管层或监管模式出现非预期的变动，某些已经存在的或者运作的交易可能被新的监管层或监管体系认定为非法交易，或受到更严格的管理，将导致基金运作承受监管风险。基金运作可能被迫进行调整，由此可能对基金净值产生影响。

(4) 政治风险。基金所投资市场因政治局势变化，如政策变化、罢工、恐怖袭击、战争、暴动等，可能出现市场大幅波动，对基金净值产生不利影响。

(5) 汇率风险。本基金投资的海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；此外，外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

(6) 利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

(7) 衍生品风险。本基金可投资于期货与期权等金融衍生品。尽管本基金将谨慎地使用衍生品进行投资，但衍生品仍可能给基金带来额外风险，包括杠杆风险、交易对手的信用风险、衍生品价格与其基础品种的相关度降低带来的风险等，由此可能会增加基金净值的波动幅度。在本基金中，衍生品将仅用于避险和进行组合的有效管理。

(8) 信用风险。信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，都可能导致基金资产损失和收益变化。

(9) 法律及税务风险。基金所投资的国家/地区在法律法规、税务政策可能与国内不同，海外市场可能要求基金就股息、利息、资本利得等收益向当地税务机构缴纳税金，使基金收益受到一定影响。此外，各国/地区的法律及税收规定可能发生变化，有可能对基金造成不利影响。

(10) 交易结算风险。海外的证券交易佣金可能比国内高。海外证券交易所、货币市场、证券交易体系以及证券经纪商的监管体系和制度与国内不同。证券交易交割时间、资金清算时间有可能比国内需要更长时间。此外，在基金的投资交易中，因交易的对手方无法履行对一位或多位的交易对手方的支付义务而使得基金在投资交易中蒙受损失。

(11) 证券借贷/正回购/逆回购风险。证券借贷的风险表现为，作为证券借出方，如果交易对手方（即证券借入方）违约，则基金可能面临到期无法获得证券借贷收入甚至借出证券无法归还的风险，从而导致基金资产发生损失。证券回购中的风险体现为，在回购交易中，交易对手方可能因财务状况或其它原因不能履行付款或结算的义务，从而对基金资产价值造成不利影响。

(12) 港股通机制下，港股投资风险。若本基金资产投资于港股，会面临因投资环境、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。

(13) 金融模型风险。投资管理人在有时会使用金融模型来进行资产定价、趋势判断、风险评估等辅助其做出投资决策。但是金融模型通常是建立在一系列的学术假设之上的，投资实践和学术假设之间存在一定的差距；而且金融模型结论的准确性往往受制于模型使用的数据的精确性。因此，投资者在使用金融模型时，面临出现错误结论的可能性，从而承担投资损失的风险。

3、第三方机构服务的风险。特别地，对于本基金，存在引入境外托管人的风险，即本基金由境外托管人提供境外资产托管服务，存在税收风险及存在因适用法律不同导致基金资产损失的风险：由于境外所适用法律法规与中国法律法规有所不同的原因，可能导致本基金的某些投资及运作行为在境外受到限制或合同不能正常执行，从而使

得基金资产面临损失风险。

4、股指期货投资风险、国债期货投资风险、股票期权风险、资产支持证券（ABS）投资风险、新股申购投资风险、融资交易及转融通证券出借业务的风险、投资于存托凭证的风险等。

#### 5、自动清算的风险

《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，基金管理人应及时通知基金托管人，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。

#### 6、其他风险

包括市场风险、流动性风险、管理风险与操作风险、技术风险、不可抗力风险等。

### （二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，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](http://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
- （5）其他重要资料

### 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，按照其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，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。**

**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的职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和基金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。**