（上接A21版）

生；

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责；

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

五、基金经理承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

六、基金管理人的内部控制制度

1、风险管理的原则

（1）全面性原则

公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节。

（2）独立性原则

公司设立独立的监察部，监察部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查。

（3）相互制约原则

公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

（4）定性和定量相结合原则

建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对风险管理负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会

负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任。

（2）风险管理委员会

作为董事会下的专业委员会之一，风险管理委员会负责批准公司风险管理系统文件，即负责确保每一个部门都有合适的系统来识别、评定和监控该部门的风险，负责批准每一个部门的风险级别。负责解决重大的突发的风险。

（3）督察长

独立行使督察权利；直接对董事会负责；按季向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议。

（4）监察法律部

监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标。

（5）风险管理部

风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

（6）业务部门

风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

3、风险管理和内部风险控制的措施

（1）建立内控结构，完善内控制度

公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织和授权，确保监察活动是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新。

（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制

建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险。

（3）建立、健全岗位责任制

建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险。

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序

建立了评估风险的委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策。

（5）建立有效的内部监控系统

建立了足够、有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

（6）使用数量化的风险管理手段

采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失。

（7）提供足够的培训

制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

第四部分　基金托管人

一、基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755-83199084

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2018年12月31日，本集团总资产67,457.29亿元人民币，高级法下资本充足率15.68%，权重法下资本充足率13.06%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金团队、系统与数据团队7个职能团队，现有员工79人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017年6月招商银行再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”；“全功能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018年1月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017年度优秀资产托管机构”奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3月荣膺公募基金20年“最佳基金托管银行”奖；5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12月荣膺2018东方财富风云榜“2018年度最佳托管银行”、“20年最值得信赖托管银行”奖。

二、主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生，本行副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991年至1995年，在中国科技国际信托投资公司工作；1995年6月至2001年10月，历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001年10月至2006年3月，历任北京分行行长助理、副行长；2006年3月至2008年6月，任北京分行党委书记、副行长（主持工作）；2008年6月至2012年6月，任北京分行行长、党委书记；2012年6月至2013年11月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013年11月至2014年12月，任招商银行总行行长助理；2015年1月起担任本行副行长；2016年11月起兼任本行董事会秘书。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

三、基金托管业务经营情况

截至2018年12月31日，招商银行股份有限公司累计托管422只证券投资基金。

四、托管人的内部控制制度

内部控制目标

招商银行确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在招商银行总行风险管控层面对风险进行预防和控制；

二级风险防范是招商银行资产托管部设立稽核监察团队，负责部门内部风险预防和控制；

三级风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，遵循内控制衡原则，视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有团队和岗位。

（2）审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点，以有效防范各种风险作为内部控制的核心，体现“内控优先”的要求。

（3）独立性原则。招商银行资产托管部各团队、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

（4）有效性原则。内部控制具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权利，内部控制存在的问题能够得到及时的反馈和纠正。

（5）适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。

（6）防火墙原则。招商银行资产托管部配备独立的托管业务技术系统，包括网络系统、应用系统、安全防护系统、数据备份系统。

（7）重要性原则。内部控制在实现全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险领域。

（8）制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

内部控制措施

（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

（2）经营风险控制。招商银行资产托管部制定托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险。

（3）业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

（4）客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

（5）信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房24小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，保证信息技术系统的安全。

（6）人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源管理。

五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定，及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

第五部分　相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、网下现金发售、网下股票发售直销机构

名称：博时基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层

办公地址：北京市建国门内大街18号恒基中心1座23层

电话：010-65187055

传真：010-65187032

联系人：韩明亮

全国统一客服热线：95105568（免长途费）

2、网下现金发售代理机构

详见基金份额发售公告。

3、网下股票发售代理机构

详见基金份额发售公告。

4、网上现金发售代理机构

详见基金份额发售公告。

二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

联系人：丁志勇

电话：0755-25941405

传真：0755-25987133

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：021- 31358666

传真：021- 31358600

联系人：安冬

经办律师：安冬、陆奇

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：沈兆杰

经办注册会计师：张振波、沈兆杰

第六部分　基金份额的发售

基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集本基金，并于2019年4月9日经中国证监会证监许可[2019]669号文准予募集注册。

一、基金名称

博时中证500交易型开放式指数证券投资基金

二、基金类型

股票型证券投资基金

三、基金存续期限

不定期

四、发售时间与发售对象

1、发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过三个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

2、发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

五、发售方式与发售场所

投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。

网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构利用深圳证券交易所网上系统以现金进行认购。

网下现金认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行认购。

网下股票认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行认购。

投资人应当在基金管理人及其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所，或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。基金管理人、发售代理机构办理基金发售业务的具体情况和联系方式，请参见基金份额发售公告。

发售代理机构的具体名单见基金份额发售公告，基金管理人可依据实际情况增减、变更发售代理机构，并另行公告。

六、基金份额发售面值、认购价格

本基金每份基金份额的发售面值为人民币1.00元，认购价格为人民币1.00元。

七、投资人对基金份额的认购

1、认购时间安排

本基金的募集期限不超过3个月，自基金份额开始发售之日起计算。

本基金自2019年7月1日至2019年7月26日进行发售。其中，网下现金发售的日期为2019年7月1日至2019年7月26日，网下股票发售的日期为2019年7月1日至2019年7月26日，网上现金发售的日期为2019年7月1日至2019年7月26日。

2、认购开户

投资人认购本基金时需具有深圳证券交易所A股账户或证券投资基金账户（以下统称“深圳证券账户”）。

已有深圳证券交易所A股账户或证券投资基金账户的投资人不必再办理开户手续。

尚无深圳证券交易所A股账户或证券投资基金账户的投资人，需在认购前持本人身份证到中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构办理深圳证券交易所A股账户或证券投资基金账户的开户手续。有关开设深圳证券交易所A股账户和证券投资基金账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。

如投资人需新开立证券账户，则应注意：

①深圳证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易，如投资人需要使用中证500指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金份额的申购、赎回，则应开立深圳证券交易所A股账户；如投资者需要使用中证500指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立上海证券交易所A股账户。

②如投资人需要通过申购赎回代理券商参与本基金的申购、赎回，应同时持有并使用深圳A股账户与上海A股账户，且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有，并注意投资人用以申购、赎回的深圳证券交易所股票的托管证券公司和上海A股账户的指定交易证券公司应为同一申购赎回代理券商，否则无法办理本基金的申购和赎回。

八、认购费用

本基金的认购采用份额认购的原则。认购费用由认购基金份额的投资人承担，认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等发售期间发生的各项费用。认购费率如下表所示：

图表1：认购费率

认购份额	认购费率
50万份以下	0.30%
50万份以上（含）—100万份以下	0.15%
100万份以上（含）	每笔500元

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。投资人可以多次认购本基金，认购费率按每笔认购申请单独计算。

九、认购申请的确认

基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

十、网上现金认购

1、认购时间：详见基金份额发售公告。

2、认购限额：网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额须为1000份或其整数倍。投资人可多次认购，累计认购份额不设上限。

3、认购金额的计算：

通过发售代理机构进行网上现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额的计算公式为：

认购费用＝认购份额×认购份额×认购费率

（或若适用固定费用的，认购费用＝固定费用）

认购金额＝认购份额×认购份额×(1＋认购费率)

（或若适用固定费用的，认购金额＝认购份额×认购份额+固定费用）

认购费用由发售代理机构向投资人收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。

网上现金认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。网上现金认购的利息和具体份额以登记结算机构的记录为准。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

利息折算的份额＝利息/认购价格

例：某投资人通过某发售代理机构以网上现金认购方式认购10,000份本基金，假设该发售代理机构确认的认购费率为0.30%，则投资人需支付的认购费用和需准备的认购金额计算如下：

认购费用＝1.00×10,000×0.30%＝30.00元

认购金额＝1.00×10,000×(1+0.30%)＝10,030.00元

即投资人需准备10,030.00元资金，方可认购到10,000份本基金基金份额。假如该笔认购金额产生利息10元，则投资者可得到10,010.00份本基金份额。

4、认购手续：投资人在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。

5、清算交收：投资者提交的认购委托，由登记机构进行有效认购款项的清算交收。

6、认购确认：在基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

十一、网下现金认购

1、认购时间：详见基金份额发售公告。

2、认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购，每笔认购份额须为1,000份或其整数倍。投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在5万份以上（含5万份），投资人可多次认购，累计认购份额不设上限。

3、认购金额的计算：

网下现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额的计算公式为：

认购费用＝认购份额×基金份额发售面值×认购费率

（或若适用固定费用的，认购费用＝固定费用）

认购金额＝认购份额×基金份额发售面值×（1＋认购费率）

（或若适用固定费用的，认购金额＝认购份额×认购份额+固定费用）

认购费用由基金管理人向投资人收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资人所有。网下现金认购的利息和具体份额以基金管理人的记录为准。利息折算的份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

利息折算的份额＝利息/认购价格

例：某投资人通过基金管理人以网下现金认购方式认购100,000份本基金，认购费率为0.30%，利息为10元，则投资人需支付的认购费用和需准备的认购金额计算如下：

认购费用＝1.00×100,000×0.30%＝300元

认购金额＝1.00×100,000×(1+0.30%)＝100,300元

利息折算的份额=10/1.00=10份

投资人实际可得份额=100,000+10=100,010份

即，投资人需准备100,300元资金方可认购到100,000份本基金基金份额，但其最终实际所得的基金份额为100,010份。

4、认购手续：投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后不得撤销。

5、清算交收：通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人进行有效认购款项的清算交收。

6、认购确认：待基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

十二、网下股票认购

1、认购时间：详见基金份额发售公告。

2、认购限额：网下股票认购以单只股票股数申报，用于认购的股票必须是中证500指数的成份股和已经公告的备选成份股。单只股票最低认购申报股数为1,000股，超过1,000股的部分须为100股的整数倍。投资人可多次提交认购申请，累计申报数不设上限。

3、认购手续：投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请提交后不得撤销。

4、特殊情形

特殊情形包括但不限于以下几种情况：

（1）已经公告的即将被调出中证500指数的成份股不得用于认购本基金。

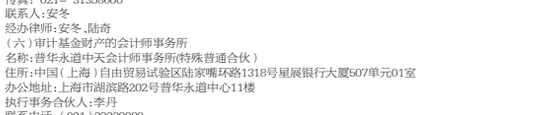
（2）限制个股认购规模：基金管理人可根据网下股票认购日前3个月的个股的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购日前至少3个工作日公告限制认购规模的个股名单。

（3）临时拒绝个股认购：对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。

5、清算交收

网下股票认购期内每日日终，发售代理机构将当日的股票认购数据按投资人证券账户汇总发送给基金管理人。T日日终（T日为本基金发售期最后一日），基金管理人初步确认各成份股的有效认购数量。T+1日起，登记结算机构根据基金管理人提供的确认数据，冻结上海市场网下认购股票，并将深圳市场网下认购股票过户至本基金组合证券认购专户。基金发售期结束后，基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资人应以基金份额方式支付的认购费用，并从投资人的认购份额中扣除，然后将扣除的认购费用以基金份额的形式返还给发售代理机构。登记机构根据基金管理人提供的投资人净认购份额明细数据进行投资人认购份额的初始登记，并根据基金管理人报深圳证券交易所确认的有效认购申请股票数据，将投资人申请认购的股票过户到基金的证券账户。

6、网下股票认购份额的计算公式



其中：

（1）i代表投资人提交认购申请的第i只股票，n代表投资人提交的股票总只数，如投资人仅提交了1只股票的申请，则n＝1；

（2）“第i只股票在网下股票认购期最后一日的均价”由本基金管理人根据证券交易所的当日行情数据，以该股票的总成交金额除以总成交股数计算，以四舍五入的方法保留小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交，则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某只股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生了除息、送股（转增）、配股等权益变动，由于投资人获得了相应的权益，基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购期最后一日的均价进行调整：

1）除息：调整后价格＝网下股票认购期最后一日均价－每股现金股利或股息

2）送股：调整后价格＝网下股票认购期最后一日均价／（1＋每股送股比例）

3）配股：调整后价格＝（网下股票认购期最后一日均价＋配股价×配股比例）／（1＋每股配股比例）

4）送股且配股：调整后价格＝（网下股票认购期最后一日均价＋配股价×配股比例）／（1＋每股送股比例＋每股配股比例）

5）除息、送股且配股：调整后价格＝（网下股票认购期最后一日均价＋配股价×配股比例－每股现金股利或股息）／（1＋每股送股比例＋每股配股比例）

（3）“有效认购数量”是指由基金管理人确认的并由登记机构完成清算交收的股票股数。其中：

1）对于经公告限制认购规模的个股，基金管理人可确认的认购数量上限为：

2）某一股票在网下股票认购期最后一日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生司法执行，基金管理人将根据登记结算机构确认的实际过户数据对投资人的有效认购数量进行相应调整。

7、网下股票认购计算举例

通过发售代理机构进行网下股票认购的投资人，认购以单只股票股数申请，在发售代理机构允许的条件下，投资人可选择以现金或基金份额的方式支付认购费用/佣金。认购份额和认购费用/佣金的计算公式为：

（1）如投资人选择以现金支付认购费用/佣金则其可得到的基金份额和需支付的认购费用/佣金如下：

认购费用/佣金按每笔认购申请单独计算，每笔认购费用/佣金=每笔股票认购份额×基金份额发售面值×认购费率或佣金比率

（2）如投资人选择以基金份额的方式交纳认购费用/佣金则其可得到的基金份额和需支付的认购费用/佣金如下：

每笔股票认购份额＝该股票在网下股票认购期最后一日的均价×有效认购数量／基金份额初始面值

认购费用/佣金按每笔认购申请单独计算，每笔认购费用/佣金=基金份额发售面值×每笔股票认购份额/（1＋认购费率或佣金比率）×认购费率或佣金比率

每笔股票净认购份额=（每笔股票认购份额－每笔认购费用或佣金）/基金份额发售面值

认购费用/佣金保留到整数位，小数点后两位舍去。

例：某投资人持有中证500指数成份股中股票A 10,000股，至某发售代理机构网点认购本基金，选择以现金支付认购费用。假设201×年×月×日股票A的均价为25.50元，基金管理人确认的有效认购数量为10,000股股票A，发售代理机构确认的认购费率为0.30%，则其可得到的基金份额和需支付的认购佣金如下：

认购份额=（10,000×25.50）÷1.00＝255,000份

认购费用=255,000×0.30%＝765元

即投资人可认购到255,000份本基金基金份额，并需另行支付765元的认购佣金。

续上例：假设该投资人选择以基金份额的方式交纳认购佣金，则投资人最终可得的净认购份额为：

认购份额=（10,000×25.50）÷1.00=255,000份

认购费用=1.00×255,000÷（1+0.30%）×0.30%=762元

净认购份额=（255,000－762）÷1.00＝254238份

如果投资人申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限，基金管理人则按照各投资人的认购申报数量同比例收取投资人提交认购的股票。

十三、募集资金利息与募集股票权益的处理方式

网下现金认购及网上现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。投资者的认购股票在股票认购日至登记机构进行股票过户日的冻结期间的权益归投资者所有。

十四、募集资金、股票与费用

基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，上述资金及网下股票认购募集的股票在基金募集行为结束前任何人不得动用。基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

十五、发行联接基金等相关业务

在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据基金发展需要，经与基金托管人协商一致并履行相关程序后，为本基金募集并管理以本基金为目标ETF的一只或多只联接基金，无须召开基金份额持有人大会审议。

第七部分　基金合同的生效

一、基金备案的条件

1、本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票按基金合同约定的估值方法计算的价值）不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。

2、基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。

3、基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。网下股票认购募集的股票在基金募集行为结束前任何人不得动用。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用。

2、在基金募集期限届满后30日内返还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息，同时将已冻结的股票解冻。

3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《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60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

第八部分　基金的份额折算与变更登记

基金合同生效后，本基金可以进行份额折算。

一、基金份额折算的时间

基金管理人应事先确定基金份额折算日，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告，并提前三个工作日以书面形式通知基金托管人。

二、基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人向登记机构申请办理，并由登记机构进行基金份额的变更登记。

基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

三、基金份额折算的方法

基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

第九部分　基金份额的上市交易

一、基金上市

基金合同生效后，在符合深圳证券交易所相关规定的条件下，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请基金份额上市。

基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应按照相关规定发布基金上市交易公告书。

二、基金份额的上市交易

基金份额在深圳证券交易所的上市交易应遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》等有关规定。

三、基金在深圳证券交易所停牌上市或终止上市的情形和处理方式

本基金份额在深圳证券交易所上市后，如遇暂停上市或终止上市的情形，按照《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的相关规定执行。

四、基金份额参考净值的计算与公告

基金管理人在每一个交易日开市前向深圳证券交易所提供当日的申购赎回清单。本基金基金份额参考净值（IOPV）由基金管理人或基金管理人委托的机构计算，并交由深圳证券交易所发布，供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

（1）基金份额参考净值的计算公式：

基金份额参考净值＝（申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额总额＋申购赎回清单中可以用现金替代的所有成份证券的数量与其最新成交价乘积之和＋申购赎回清单中禁止用现金替代的所有成份证券的数量与其最新成交价乘积之和＋申购赎回清单中的预估现金部分）／最小申购赎回单位所对应的基金份额

（2）深圳证券交易所可以调整基金份额参考净值的计算公式，并予以公告。

五、其他

若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，本基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

相关法律法规、中国证监会、登记机构及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

第十部分　基金转型的情况

一、当本基金发生《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金将转型为非上市的开放式指数基金，基金名称变更为“博时中证500指数证券投资基金”，无需召开基金份额持有人大会。

基金转型并终止上市后，对于场内份额的处理、申购赎回等规则由基金管理人提前制定并公告。

二、转型后基金的投资

（一）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。在正常市场情况下，本基金力争追求预期日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，预期年化跟踪误差控制在2%以内。

（二）基金的投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、股票期权、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、货币市场工具（包括银行存款、同业存单、债券回购等）、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）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资、融券及转融通证券出借业务。本基金根据相关法律法规或中国证监会要求履行相关手续后，还可以投资于法律法规或中国证监会未来允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不