博时创业板交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

博时创业板交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的发行已获中国证监会证监许可号文批准。自2011年05月03日至2011年06月03日通过销售机构公开发售。本基金为契约型开放式，存续期间为不定期。本基金的基金合同于2011年06月10日正式生效 。

【重要提示】

博时创业板交易型开放式指数证券投资基金由深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金转型而来。2019年12月3日，以通讯方式召开的深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会审议并通过了《关于深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金变更名称、修改基金投资标的指数、修改基金投资范围、修订基金合同等事项。自2018年12月10日起，《深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金基金合同》失效且《博时创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》同时生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金的变更注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。同时由于本基金是跟踪创业板指数的交易型开放式基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。投资本基金可能遇到的风险还包括：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、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、退市风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、不可抗力等等。本基金被动跟踪标的指数“创业板指数”，因此，本基金的业绩表现与创业板指数的表现密切相关。同时，本基金为股票型基金，其长期平均预期风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

本基金投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、权证、股指期货、期权、债券、货币市场工具、资产支持证券等，在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下，如证券市场的成交量发生急剧萎缩，基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下，可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击，发生基金份额净值波动幅度较大；无法进行正常赎回业务，基金不能实现既定的投资决策等风险。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。基金合同、本招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，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。

本招募说明书按照本基金管理人于2019年10月18日发布的《关于博时创业板交易型开放式指数证券投资基金交易结算模式调整并相应修改招募说明书的公告》进行更新，所载其他内容的截止日为2019年06月10日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年03月31日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

一、基金管理人概况

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：广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层

法定代表人：张光华

成立时间：1998年7月13日

注册资本：25亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：韩强

联系电话：（0755）8316 9999

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26号文批准设立。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份49%；中国长城资产管理公司，持有股份25%；天津港（集团）有限公司，持有股份6%；上海汇华实业有限公司，持有股份12%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份2%。注册资本为2.5亿元人民币。

公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设拥有大总部和二十八个直属部门，分别是：权益投资总部、固定收益总部以及宏观策略部、交易部、指数与量化投资部、多元资产管理部、年金投资部、绝对收益投资部、产品规划部、销售管理部、客户服务中心、市场部、养老金业务中心、战略客户部、机构一上海、机构一南方、券商业务部、零售一北京、零售一上海、零售一南方、央企业务部、互联网金融部、董事会办公室、办公室、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、风险管理部和监察法律部。

权益投资总部负责公司所管理资产的权益投资管理及相关工作。权益投资总部下设股票投资部（含各投资风格小组）、特定资产管理部、研究部、股票投资部负责进行股票选择和组合管理，特定资产管理部负责公司权益类特定资产专户和权益类大保险资产组合的投资管理及相关工作。研究部负责完成对宏观经济、投资策略、行业上市公司及市场的研究。固定收益总部负责公司所管理资产的固定收益投资管理及相关工作。固定收益总部下设现金管理组、公募基金组、专户组、指数组、创新组、国际组和研究组，分别负责各类固定收益资产的研究和投资工作。

市场部负责市场竞争分析、市场政策制订；组织落实公司战略目标、市场战略、协同产品和投资体系以及市场团队的协同；拟订年度市场计划和费用预算，具体负责机构业务的绩效考核和费用管理；公司品牌及产品传播；机构产品营销组织、市场分析等工作。战略客户部负责为地区机构投资者和财政资金提供投资顾问及投资管理业务以及该区域机构客户的销售与服务工作。机构一上海和机构一南方分别负责华东、华南、华北地区以及其他指定区域的机构客户销售与服务工作。养老金业务中心负责公司社保基金、企业年金、基本养老金及职业年金的客户拓展、销售与服务，养老金研究与政策咨询、养老金销售支持与中台运作协调、相关信息服务等工作。券商业务部负责券商渠道的开拓和销售服务。零售一北京、零售一上海、零售一南方负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。央企业务部负责招商局集团范围内机构客户、重要中央企业及其财务公司等客户的拓展、合作业务落地与服务等工作。销售管理部负责公司年渠道维护、零售产品营销组织、销售督导；营销策划及分析销售支持；营销培训管理；渠道代销支持与服务；零售体系的绩效考核与费用管理等工作。

宏观策略部负责为投委会审定资产配置计划提供宏观研究和策略研究支持。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。指数与量化投资部负责公司各类指数与量化投资产品的研究和投资管理工作。多元资产管理部负责公司的基金中基金投资产品的研究和投资管理工作。年金投资部负责公司所管理企业年金等养老金资产的投资管理及相关工作。绝对收益投资部负责公司绝对收益产品的研究和投资管理工作。产品规划部负责新产品设计、新产品报批、主管部门沟通维护、产品维护以及年金方案设计等工作。互联网金融部负责公司互联网金融战略规划的设计和实施，公司互联网金融的平台建设、业务拓展和客户运营，推动公司相关业务在互联网平台的整合与创新。客户服务中心负责电话与网络咨询与服务；呼出业务与电话营销理财；营销系统数据维护与挖掘；直销柜台业务；专户合同及备案管理、机构售前支持；专户中台服务与运营支持等工作。

董事会办公室专门负责股东会、董事会、监事会及董事会各专业委员会各项会务工作；股东关系管理与董、监事的联络、沟通及服务；基金行业政策、公司治理、战略发展研究、公司文化建设；与公司内部及外部监管机构关系的维护与信息披露管理；政府公共关系管理；博时基金基金会的管理及运营等。办公室负责公司的行政后勤支持、会议及文件管理、外事活动管理、档案管理及工会工作等。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、员工沟通、人力资源信息管理工作。财务部负责公司预算管理、财务核算、成本控制、财务分析等工作。信息技术部负责信息系统开发、网络运行及维护、IT系统安全及数据备份等工作。基金运作部负责基金会计和基金注册登记等业务。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。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察，并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。

另设北京分公司和上海分公司，分别负责对驻京、沪人员日常行政管理和对驻京、沪、处理外资人员给予协助。此外，还设有全资子公司博时资本管理有限公司，以及境外子公司博时基金（国际）有限公司。

截止到2019年6月30日，公司总人数为570人，其中研究员和基金经理超过89%拥有硕士及以上学位。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

二、主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

张光华先生，博士，董事长。历任国家外汇管理局政研室副主任，计划处处长，中国人民银行海南省分行副行长、党委委员，中国人民银行广州分行副行长、党委副书记，广东发展银行行长、党委副书记，招商银行副行长、执行董事、副董事长、党委副书记、表决权银行任职期间官兼任法人代表、董事长、招商基金管理有限公司董事长、招商资诺人寿保险有限公司董事长、招银国际金融有限公司董事长、招银金融租赁有限公司董事长。2015年8月起，任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人。

江向阳先生，董事，2015年7月起任博时基金管理有限公司总经理。中共党员，南开大学国际金融博士，清华大学金融媒体EMBA。1986－1990年就读于北京师范大学信息与情报学系，获学士学位；1994－1997年就读于中国政法大学研究生院，获法学硕士学位；2003－2006年，就读于南开大学国际经济研究所，获国际金融博士学位。2015年1月至7月，任招商局金融集团副总经理，博时基金管理有限公司董事。曾任中国证监会办公厅副巡视员；中国证监会深圳专员办处长、副专员；中国证监会期货监管部副处长、处长；中国农业工程研究设计院情报室干部。

苏敏女士，分别于1990 年7 月及2002 年12 月获得上海财经大学金融专业学士学位和中国科学技术大学工商管理硕士学位。苏女士分别于1998 年6 月、1999 年6 月及2008 年6 月获中国注册会计师协会授予的注册会计师资格、中国资产评估协会授予的注册资产评估师资格及安徽省人力资源和社会保障厅授予的高级会计师职称。苏女士拥有管理金融类公司及上市公司的经验，其经验包括：自2015 年9 月及2015 年12 月起任招商局金融集团有限公司总经理及董事；自2016年6月起任招商证券股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600999；香港联交所上市公司，股票代码：6099）董事；自2014 年9 月起担任招商银行股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600036；香港联交所上市公司，股票代码：3968）董事。自2016 年1 月至2018年8月任招商局金融投资有限责任公司董事；自2015 年11 月至2018年8月任招商局创新投资管理有限公司董事；自2015 年11 月至2017 年4 月任深圳招商启航互联网投资管理有限公司董事；自2013 年5 月至2015 年8 月任中远海运能源运输股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600026；香港联交所上市公司，股票代码：1138）董事；自2013 年6月至2015 年12 月任中远海运发展股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：601866；香港联交所上市公司，股票代码：2866）董事；自2009 年12 月至2011 年5 月担任徽商银行股份有限公司（香港联交所上市公司，股票代码：3698）董事；自2008 年3 月至2011年9 月担任安徽省皖能股份有限公司（深圳证券交易所上市公司，股票代码：000543）董事。苏女士亦拥有会计等相关管理经验，其经验包括：自2011 年3 月至2015 年8 月担任中海运（集团）总公司总会计师；自2007 年6 月至2011 年4 月担任该公司副总经理。2018年9月3日起，任博时基金管理有限公司第七届董事会董事。

王金宝先生，硕士，董事。1988年7月至1995年4月在上海同济大学数学系工作，任教师。1995年4月进入招商证券，先后任上海澳门路营业部总经理、上海地区总部副总经理（主持工作）、投资部总经理、投资部总经理兼固定收益部总经理、股票销售交易部总经理（现更名为机构业务总部）、机构业务董事总经理。2002年10月至2006年7月，任博时基金管理有限公司第二届、第三届董事会董事。2008年7月起，任博时基金管理有限公司第四届至第六届董事会董事。

陈克庆先生，北京大学工商管理硕士。2001年起历任世纪证券投资银行北京总部副总经理，国信证券投行业务部副总经理，华西证券投资银行总部副总经理、董事总经理。2014年加入中国长城资产管理公司，现任投资投行事业部副总经理。

袁庆伟先生，资产托管业务中心总裁，高级经济师。

袁女士2015年8月起任本公司资产托管业务中心总裁；2007年12月至2015年8月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999年12月至2007年12月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长、会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005年于新疆财经学院获硕士学位。

（三）基金托管业务经营情况

截至2019年3月31日，交通银行共托管证券投资基金418只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保险管理基金、企业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、ODII证券投资资产、RQDII证券投资资产和QDLP资金等产品。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，托管中心业务制度健全并确保贯彻执行各项规章，通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释，有效地实现对各项业务的风险控制，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

（二）内部控制原则

1、合规性原则：托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

2、全面性原则：托管中心建立各二级部门我投资内部风险管理的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管中心独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管中心内部动态岗位设置、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管中心在内控、业务二级部和风险管理二级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障各项内控管理目标被有效执行。

6、效益性原则：托管中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低控制成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

（三）内部控制制度及措施：

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管中心制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务会计核算管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管部业务应急管理办法》、《交通银行资产托管部保密委员会工作规则》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务档案管理办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

托管中心通过对基金托管业务各环节的审前揭示、事中控制和事后检查措施实现资金流程、全链条的风险管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

三、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

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购赎回的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人有违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行有权报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人有重大违规行为，有权立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银保监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

三、相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、直销机构

博时基金管理有限公司北京直销中心

名称：博时基金管理有限公司北京直销中心

地址：北京市建国门内大街18号恒基中心1座23层

电话：+86-10-65187055

传真：010-65187032、010-65187592

联系人：韩明亮

博时一线通：95105568（免长途话费）

2、代销机构

(1)招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路2008号

办公地址：中国深圳福田区益田路江苏大厦A座38－45层

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

电话：0755－82943666

传真：0755－83734343

客户服务电话：4008888111；95565

网址：http://www.newone.com.cn/

(2)广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183－187号大都会广场43楼（4301－4316房）

办公地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：020－87555888

传真：020－87555305

客户服务电话：95575或020－95575

网址：http://www.gf.com.cn/

(3)中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人：张佑君

联系人：马静懿

电话：010－60833889

传真：010－84865560

客户服务电话：400－889－5548/95548

网址：http://www.cs.ecitic.com/

(4)中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2－6层

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

电话：010－83574507

传真：010－66568990

客户服务电话：95551/4008888888

网址：http://www.chinastock.com.cn/

(5)海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人：周杰

联系人：李芙艳

电话：021－23219275

传真：021－63602722

客户服务电话：95553

网址：http://www.htsec.com/

(6)兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东民生路1199弄五道口广场1号楼21层

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

电话：021－38565547

传真：021－38565783

客户服务电话：4008888123/95562

网址：http://www.xyzq.com.cn/

(7)湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

法定代表人：孙永祥

联系人：李欣

电话：021－38784580－8918

传真：021－68865680

客户服务电话：95351

网址：http://www.xcsc.com

(8)华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路228号

办公地址：上海地铁南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦18楼

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：0755－82492193

传真：0755－82492962（深圳）

客户服务电话：95597

网址：http://www.htsc.com.cn/

(9)中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东2.5层

法定代表人：姜晓林

联系人：孙秋月

电话：0532－85022026

传真：0532－85022026

客户服务电话：95548

网址：http://www.zxzqsd.com.cn/

(10)东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12－15层

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12－15层

法定代表人：魏庆华

联系人：和志鹏

电话：18010150340

传真：010－66555246

客户服务电话：4008888993

网址：http://www.dxzq.net

(11)万正证券股份有限公司

注册地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22－24层

办公地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22－24层

法定代表人：施华

联系人：程博怡

电话：010－56437060

传真：0731－85832214

客户服务电话：95597

网址：http://www.foundersc.com

(12)长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦16、17层

办公地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：丁益

联系人：沈璐

电话：0755－83464734

传真：0755－83515567

客户服务电话：4006666888

网址：http://www.cgws.com

(13)中银国际证券股份有限公司

注册地址：中国上海浦东银城中路200号中银大厦39－40层

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

法定代表人：宁敏

联系人：许慧琳

电话：021－20328531

传真：021－50372474

客户服务电话：4006208888；021－61195566

网址：http://www.bocichina.com

(14)中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经十路20518号

办公地址：山东省济南市经七路86号23层

法定代表人：李玮

联系人：朱琴

电话：021－20315161

传真：0531－68889357

客户服务电话：95538

网址：www.zts.com.cn

(15)华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

联系人：张宗悦

电话：0591－87383623

传真：0591－87383610

客户服务电话：95547

网址：http://www.hfzq.com.cn

(16)中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层－21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：高涛

联系人：方玉琳

电话：0755－82026907

传真：0755－82026539

客户服务电话：4006008008/95532

网址：http://www.china-inv.cn/

(17)中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京西城区金融大街5号新盛大厦A座

办公地址：北京西城区金融大街5号新盛大厦A座613

法定代表人：赵大建

联系人：李微

电话：010－59355941

传真：010－66553791

客户服务电话：400－889－5618/95571

网址：http://www.e5618.com

(18)天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼

法定代表人：余磊

联系人：程晓亮

电话：027－87107535

客户服务电话：400－800－5000/95391

网址：http://www.tfzq.com/

二、登记机构

1、中国证券登记结算有限责任公司

住所、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：崔巍

电话：010－50378856

传真：010－59378907

2、博时基金管理有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层

办公地址：北京市建国门内大街18号恒基中心1座23层

法定代表人：张光华

电话：（010）65171166－2189

传真：（010）65187068

联系人：许鹏

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海开通力律师事务所

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、审计基金资产的会计师事务所

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

四、基金的名称

博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

股票型基金。

六、基金运作方式

本基金运作方式为契约型开放式，存续期间为不定期。

七、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

八、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）、权证、股指期货、期权、债券、货币市场工具、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。

在建仓完成后，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低于基金资产净值的85%，权证、股指期货、期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

九、投资策略

1、组合复制策略

本基金主要采用完全复制法进行投资，采用完全复制法，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。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于日由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求年跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪误差的进一步扩大。

为了实现更好的跟踪标的指数的目的，基金管理人还将综合考虑标的指数成份股的数量、流动性、投资限制、交易费用及成本，以及税务及其他监管限制，决定是否采用抽样复制的策略。对于复制方法的变更，本基金管理人需在方法变更的2个工作日内在指定媒介公告，并阐明变更复制方法的原因。

2、衍生品投资策略

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。

（1）权证投资策略

本基金将通过对权证标的证券的基本面研究，结合多种定价模型，根据基金资产组合情况适度进行权证投资。

（2）股指期货投资策略

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票现货组合的资金成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

（3）期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关规定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

本基金投资期权，基金管理人将根据审慎原则，建立期权交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责期权投资的具体事宜。

3、融资及转融通证券出借

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通证券出借业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通证券出借业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的规定为准。

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。

十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即创业板指数收益率。

如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，通过适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于指标机构变更，指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

十一、风险收益特征

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，属于高风险/高收益的开放式基金。

本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪创业板指数，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。

十二、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2019年03月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	112,815,486.93	98.71
	其中：股票	112,815,486.93	98.71
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	1,152,596.41	1.01
8	其他各项资产	322,726.62	0.28
9	合计	114,290,809.96	100.00

注：股票投资项包含可退替代款估值增值。

2报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	13,997,256.00	12.30
B	采矿业	–	–
C	制造业	51,947,347.60	45.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	503,408.00	0.44
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,512,391.00	25.93
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	671,848.00	0.59
M	科学研究和技术服务业	2,242,890.00	1.97
N	水利、环境和公共设施管理业	2,859,133.68	2.51
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	5,270,654.00	4.63
R	文化、体育和娱乐业	5,809,982.65	5.11
S	综合	–	–
	合计	112,814,910.93	99.14

注：上述按行业分类的境内股票投资组合的合计项不包含可退替代款估值增值。

3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300498	温氏股份	344,760	13,997,256.00	12.30
2	300059	东方财富	355,900	6,897,342.00	6.06
3	300142	沃森生物	108,200	2,759,100.00	2.42
4	300015	爱尔眼科	77,800	2,645,200.00	2.32
5	300124	汇川技术	96,000	2,518,080.00	2.21
6	300003	乐普医疗	92,600	2,453,900.00	2.16
7	300136	信维通信	76,300	2,198,966.00	1.93
8	300024	机器人	112,300	2,144,930.00	1.88
9	300122	智飞生物	41,700	2,130,870.00	1.87
10	300408	三环集团	99,000	2,053,260.00	1.80

4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金未投资股指期货交易。

10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期末本基金未投资国债期货交易。

11投资组合报告附注

11.1报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

11.2报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,887.74
2	应收证券清算款	320,573.60
3	应收股利	–
4	应收利息	265.28
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	322,726.62

11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300124	汇川技术	2,518,080.00	2.21	公告重大事项

11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十三、基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

自基金合同生效开始，基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

期间	①净值增长率	②净值增长率标准差	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率标准差	①－③	②－④
2011.06.10－2011.12.31	－28.79%	1.31%	－25.35%	1.42%	－3.44%	－0.11%
2012.01.01－2012.12.31	0.76%	1.40%	0.97%	1.41%	－0.21%	－0.01%
2013.01.01－2013.12.31