关于博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金调整申购赎回规则并相应修改基金合同和招募说明书的公告

深圳证券交易所（以下简称“深交所”）于2020年12月4日公告了《关于修改<深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则>相关条款的通知（深证会〔2020〕730号）》（以下简称“《通知》”）。根据《通知》，深交所将《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》（以下简称“《实施细则》”）第五十四条第三项修改为：“（三）跨市场股票ETF：指所跟踪股票指数成份证券除本所上市股票外，还包括境内其他市场交易股票或港股通标的股票，且申赎对价包含组合证券的ETF”，优化了投资深沪港三地市场的跨市场股票ETF申购赎回模式，相关修改自2020年12月28日起施行。

为更好地满足投资者需求，根据修订后的《实施细则》及《博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”），博时基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“本公司”）经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致并报中国证监会备案，拟修改博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“博时大湾区ETF”或“本基金”）《基金合同》、《博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）的相应条款，具体修订内容请见附件对照表。

本公告仅对博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金根据《实施细则》相应修改《基金合同》和《招募说明书》的事项进行说明。本基金管理人此次因相应的法律法规、深圳证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动对《基金合同》和《招募说明书》进行修改，符合相关法律法规及基金合同的规定，无需经基金份额持有人大会表决，本公司已就相关事项履行了规定的程序。本基金《基金合同》和《招募说明书》的修改自2020年12月28日起生效。

投资者可拨打博时一线通：95105568（免长途费）或可登录本公司网站www.bosera.com了解相关情况。

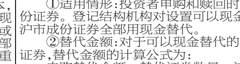
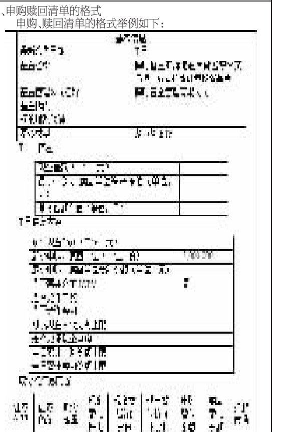
特此公告。

博时基金管理有限公司
2020年12月21日

《博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》修订前后对照表

章节	修订前	修订后
第二部分释义	46. 申购对价：指投资人申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。本基金的申购采用全现金替代，基金管理人代买代卖的模式，申购对价包括现金替代、现金差额及其他对价 47. 赎回对价：指投资人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。本基金的赎回采用全现金替代，基金管理人代买代卖的模式，赎回对价包括现金替代、现金差额及其他对价	46. 申购对价：指投资人申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价 47. 赎回对价：指投资人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价
	73. 特定投资者：指不通过代办证券公司经纪交易单元，而通过基金管理人直销申报跨境股票ETF申购赎回申请的保险产品、全国社保基金、证券投资基金、证券集合资产管理计划等特殊机构及产品投资者	73. 特定投资者：指《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司交易型开放式基金登记结算业务指南》规定的不通过代办证券公司经纪交易单元，而通过基金管理人直销申报跨市场股票ETF申购赎回申请的保险产品、全国社保基金、证券投资基金、证券集合资产管理计划等特殊机构及产品投资者
第九部分基金份额的申购与赎回	基金合同生效后，本基金的申购赎回采用全现金替代，基金管理人代买代卖的模式，申购对价、赎回对价包括现金替代、现金差额及其他对价。未来在深圳证券交易所和登记机构系统允许的情况下，在履行适当程序后，本基金可以开通上海证券交易所、深圳证券交易所上市股票及港股通标的股票的部分或全部实物申购赎回模式，申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价，相关事项届时将另行约定并公告，无须召开持有人大会。	
	一、申购和赎回场所 基金管理人在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况变更申购赎回代理券商，并予以公告。	一、申购和赎回场所 基金管理人在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况变更申购赎回代理券商，并在基金管理人网站公示。
	三、申购与赎回的原则 2、本基金的申购对价、赎回对价包括现金替代、现金差额及其他对价；	三、申购与赎回的原则 2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
	四、申购与赎回的程序 1、申购和赎回的申请方式 …… 投资人交付申购对价，申购成立；登记机构确认申请时，申购生效。投资人在提交赎回申请时有足够的赎回对价，则赎回申请成立，登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人在提交申购申请时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请不成立。 2、申购和赎回申请的确认 无 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基金份额、现金替代、现金差额及其他对价的交收适用《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》的规定和参与各方相关协议的有关规定，详见招募说明书。 …… 投资者应按照本基金合同的约定和申购、赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额和现金替代退补款。因投资者原因导致现金差额或现金替代退补款未能按时足额交收的，基金管理人有权为基金的利益向该投资者追偿，并要求其承担由此导致的其他基金份额持有人或基金资产的损失。	四、申购与赎回的程序 1、申购和赎回的申请方式 …… 投资人交付申购对价，申购成立；登记机构确认申请时，申购生效。投资人在提交赎回申请时有足够的基金份额余额和现金，则赎回申请成立，登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人在提交申购申请时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请不成立。 2、申购和赎回申请的确认 在目前规则下，基金投资人申购的基金份额当日可竞价卖出，次一交易日可赎回；投资人赎回获得的股票当日可竞价卖出，次一交易日可以用于申购ETF份额。基金投资人申购的基金份额和赎回获得的股票均需完成交收后方可通过大宗交易卖出。 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组合证券、基金份额、现金替代、现金差额及其他对价的交收适用中国证券登记结算有限责任公司及相关证券交易所最新的相关规则以及参与各方相关协议的有关规定，详见招募说明书。 …… 投资者应按照本基金合同的约定和申购、赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额和现金替代退补款；若投资人用以申购的部分或全部组合证券或者用以赎回的部分或全部基金份额因被国家有关机关冻结或强制执行导致不足额的，基金管理人有权指示申购赎回代理券商及登记机构依法进行相应处置。如上述情况导致其他基金份额持有人或基金资产遭受损失的，基金管理人有权代表其他基金份额持有人或基金资产要求该投资者进行赔偿。
	六、申购和赎回的对价、费用 2、申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资人赎回基金份额时，基金管理人应交付给投资人的现金替代、现金差额及其他对价。	六、申购和赎回的对价、费用 2、申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资人赎回基金份额时，基金管理人应交付给投资人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
	九、基金清算交收与登记模式的调整或新增 本基金获批后，若深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司针对交易型开放式证券投资基金推出新的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，本基金管理人有权调整本基金的清算交收与登记模式及申购、赎回方式，或新增本基金的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，届时将发布公告予以披露并对本基金的基金合同和招募说明书予以更新，无须召开持有人大会审议。	九、基金清算交收与登记模式的调整或新增 本基金获批后，若深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司针对交易型开放式证券投资基金推出新的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，本基金管理人有权调整本基金的清算交收与登记模式及申购、赎回方式，或新增本基金的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，届时将发布公告予以披露并对本基金的招募说明书予以更新，无须召开持有人大会审议。
	十五、其他 1、未来在深圳证券交易所和登记机构系统允许的情况下，在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经履行相关程序后，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资者集合其持有的组合证券共同构成最小申购赎回单位或其整数倍进行申购。基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则。	十五、其他 1、未来在深圳证券交易所和登记机构系统允许的情况下，在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经履行相关程序后，基金管理人可开放集合申购（或集中申购，业务名称以深圳证券交易所业务规则为准），即允许多个投资者集合其持有的组合证券共同构成最小申购赎回单位或其整数倍进行申购。基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则。

《博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》修订前后对照表

章节	修订前	修订后
【重要提示】	基金合同生效后，本基金的申购赎回采用全现金替代，基金管理人代买代卖的模式，申购对价、赎回对价包括现金替代、现金差额及其他对价。未来在深圳证券交易所和登记机构系统允许的情况下，在履行适当程序后，本基金可以开通上海证券交易所、深圳证券交易所上市股票及港股通标的股票的实物申购赎回模式，申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价，相关事项届时将另行约定并公告，无须召开持有人大会。	本基金按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定进行申购、赎回，具体业务的办理时间请参见相关公告。本基金通过深圳证券交易所办理申购赎回的，投资者的申购、赎回申请在T日确认，申购所得ETF份额T日可竞价卖出，T+1 日可赎回；赎回所得的组合证券T日可竞价卖出。如投资者需要通过申购赎回代理券商参与本基金的场内申购赎回（通过深圳证券交易所办理），则应开立深圳证券交易所A股账户。
第二部分释义	修改内容同《基金合同》	
第九部分基金份额的上市交易	四、基金份额参考净值的计算与公告 （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（若为港股通，按照汇率公允价格调整为人民币价格）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	四、基金份额参考净值的计算与公告 （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（若为港股通，按照汇率公允价格调整为人民币价格）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（若为港股通，按照汇率公允价格调整为人民币价格）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
第十一部分基金份额的申购与赎回	基金合同生效后，本基金的申购赎回采用全现金替代，基金管理人代买代卖的模式，申购对价、赎回对价包括现金替代、现金差额及其他对价。未来在深圳证券交易所和登记机构系统允许的情况下，在履行适当程序后，本基金可以开通上海证券交易所、深圳证券交易所上市股票及港股通标的股票的部分或全部实物申购赎回模式，申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价，相关事项届时将另行约定并公告，无须召开持有人大会。	
	一、申购和赎回场所 基金管理人在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况变更申购赎回代理券商，并予以公告。	一、申购和赎回场所 基金管理人在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况变更申购赎回代理券商，并在基金管理人网站公示。
	三、申购与赎回的原则 2、本基金的申购对价、赎回对价包括现金替代、现金差额及其他对价；	三、申购与赎回的原则 2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
	四、申购与赎回的程序 1、申购和赎回的申请方式 …… 投资人交付申购对价，申购成立；登记机构确认申请时，申购生效。投资人在提交赎回申请时有足够的赎回对价，则赎回申请成立，登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人在提交申购申请时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请不成立。 2、申购和赎回申请的确认 本基金获批后，若深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司针对交易型开放式证券投资基金推出新的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，本基金管理人将根据新的业务规则新增或调整申购和赎回申请的确认方式，届时将发布公告予以披露并对本基金的基金合同和招募说明书予以更新，无须召开持有人大会审议。	四、申购与赎回的程序 1、申购和赎回的申请方式 …… 投资人交付申购对价，申购成立；登记机构确认申请时，申购生效。投资人在提交赎回申请时有足够的基金份额余额和现金，则赎回申请成立，登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人在提交申购申请时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请不成立。 2、申购和赎回申请的确认 在目前规则下，基金投资人申购的基金份额当日可竞价卖出，次一交易日可赎回；投资人赎回获得的股票当日可竞价卖出，次一交易日可以用于申购ETF份额。基金投资人申购的基金份额和赎回获得的股票均需完成交收后方可通过大宗交易卖出。 本基金获批后，若深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司针对交易型开放式证券投资基金推出新的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，本基金管理人将根据新的业务规则新增或调整申购和赎回申请的确认方式，届时将发布公告予以披露并对本基金的招募说明书予以更新，无须召开持有人大会审议。
第十一部分基金份额的申购与赎回	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基金份额、现金替代、现金差额及其他对价的交收适用《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》的规定和参与各方相关协议的有关规定。…… 本基金现金申购业务中的现金替代采用实时逐笔全额结算（RTGS）与日终逐笔全额非担保交收的方式处理；现金赎回业务中的现金替代采用代收代付处理；现金申购、赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付处理。 投资者T日提交的现金申购申请受理后，日间完成RTGS交收部分，登记机构在T日为该投资者办理基金份额登记以及现金替代的交收；日间未完成RTGS交收部分，登记机构在T日日终为该投资者办理基金份额登记以及现金替代的交收，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。基金管理人在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。 投资者T日提交的现金赎回申请受理后，登记机构在T日收市后为投资者办理基金份额的清算交收，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。基金管理人在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。现金赎回替代款的清算交收由基金管理人和申购赎回代理券商协商处理，正常情况下，该款项的清算交收于T+7日（指开放日）内办理，但如果出现港股通暂停交易或交收、流动性不足等原因导致无法足额卖出，则该款项的清算交收可延迟办理。 …… 投资者应按照基金合同的约定和申购、赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额和现金替代补款。因投资者原因导致现金差额或现金替代补款未能按时足额交收的，基金管理人有权为基金的利益向该投资者追偿，并要求其承担由此导致的其他基金份额持有人或基金资产的损失。	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组合证券、基金份额、现金替代、现金差额及其他对价的交收适用中国证券登记结算有限责任公司及相关证券交易所最新的相关规则以及参与各方相关协议的有关规定。…… 对于本基金的申购业务采用净额结算的方式，即深圳证券交易所上市的成份股的现金替代及对应的上海证券交易所、香港证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算；对于本基金的赎回业务，深圳证券交易所上市的成份股的现金替代及上海证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算，香港证券交易所上市的成份股对应的全额现金替代采用代收代付交收；本基金上述申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付交收。 投资者T日申购成功后，登记机构在T日收市后为该投资者办理深圳证券交易所上市的成份股与基金份额登记的交收、现金替代（包括沪市股票、深市股票及港股涉及到的现金替代）的清算；在T+1日办理现金替代的交收以及现金差额的清算，在T+2日办理现金差额的交收，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。 投资者T日赎回成功后，登记机构在T日收市后为投资者办理基金份额的注销与深圳证券交易所上市的成份股的交收、沪市及深市股票现金替代的清算；在T+1日办理沪市及深市股票现金替代的交收、现金差额的清算，在T+2日办理现金差额的交收，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。香港证券交易所上市的成份股的现金赎回替代款的清算交收由基金管理人和申购赎回代理券商协商处理，正常情况下，该款项的清算交收于T+7日（指开放日）内办理，但如果出现港股通暂停交易或交收、流动性不足等原因导致无法足额卖出，则该款项的清算交收可延迟办理。 …… 投资者应按照基金合同的约定和申购、赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额和现金替代退补款；若投资人用以申购的部分或全部组合证券或者用以赎回的部分或全部基金份额因被国家有关机关冻结或强制执行导致不足额的，基金管理人有权指示申购赎回代理券商及登记机构依法进行相应处置。如上述情况导致其他基金份额持有人或基金资产遭受损失的，基金管理人有权代表其他基金份额持有人或基金资产要求该投资者进行赔偿。
	六、申购与赎回的对价和费用 1、申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资人赎回基金份额时，基金管理人应交付给投资人的现金替代、现金差额及其他对价。	六、申购与赎回的对价和费用 1、申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资人赎回基金份额时，基金管理人应交付给投资人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
	2、申赎现金 “申赎现金”不属于组合成份证券，是为了便于登记机构的清算交收安排，在申购赎回清单中增加的虚拟证券。“申赎现金”的现金替代标志为“必须”，但含义与组合成份证券的必须现金替代不同，“申赎现金”的申购替代金额为最小申购单位所对应的成份证券的必须现金替代与可以现金替代金额之和，赎回替代金额固定为0。	2、申赎现金 “申赎现金”不属于组合成份证券，是为了便于登记机构的清算交收安排，在申购赎回清单中增加的虚拟证券。“申赎现金”的现金替代标志为“必须”，但含义与组合成份证券的必须现金替代不同，“申赎现金”的申购替代金额为最小申购单位所对应的现金替代标志为“必须”的非深市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的非深市成份证券的申购替代金额之和，赎回替代金额为最小赎回单位所对应的现金替代标志为“必须”的沪市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的沪市成份证券的赎回替代金额之和。
		3、组合证券相关内容 组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。
	3、现金替代相关内容 …… 现金替代分为2种类型：可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。 可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代。 必须现金替代适用于所有成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。	4、现金替代相关内容 …… （1）现金替代分为3种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。 对于深市成份证券，现金替代的类型可以设为：“禁止”、“允许”和“必须”。 对于非深市成份证券，可以设为：“允许”和“必须”。 禁止现金替代适用于深市成份证券，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。 可以现金替代适用于所有成份证券。当可以现金替代适用于深市成份证券时，可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。当可以现金替代适用于非深市成份证券时，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。
	（1）关于可以现金替代 1）适用情形：可以现金替代的证券是指基金管理人认为需要在投资者申购或赎回时代投资者买入或卖出的证券。 2）申购现金替代保证金：对于可以现金替代的证券，申购现金替代保证金的计算公式为： ①港股通标的股票替代金额＝替代证券数量×该证券T日预计开盘价×T−1日估值汇率 ②深圳证券交易所、上海证券交易所上市股票替代金额＝替代证券数量×该证券T日预计开盘价 申购现金替代保证金＝替代金额×（1＋现金替代溢价比例） “现金替代溢价比例”也称“现金替代保证金率”。收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金的实际买入价格（或证券实际结算价格）加上相关交易费用后与申购时证券的参考收盘价可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。一般情况下现金替代溢价比例为10%，基金管理人可以根据市场情况和实际需要调整现金替代溢价比例，具体的现金替代溢价比例以申购赎回清单公告为准。 申购时，如果预先收取的金额高于基金买入证券的实际成本（或证券实际结算成本），则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金买入证券的实际成本（或证券实际结算成本），则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。 3）申购现金替代保证金的处理程序 对于确认成功的T日申购申请，T+1日（指开放日）内基金管理人根据申购规模进行组合证券的代理买入。 对于成分证券中港股通标的的股票，T+1日（指开放日）日终，基金管理人根据所购入的被替代证券的实际单位购入成本（包括买入价格与相关费用）和未买入的被替代证券的T+1日（指开放日）收盘价（折算为人民币，折算汇率采用当天的估值汇率；T+1日（指开放日）在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价）计算被替代证券的单位结算成本，在此基础上根据替代证券数量和申购现金替代保证金确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。在此期间若该部分证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。正常情况下，T+5日（指开放日）内，基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给登记机构，登记机构办理现金替代多退少补资金的清算，并将结果发送给相关申购赎回代理机构和基金托管人，相关款项的交收于数据发送后的第1个工作日内完成。 如遇港股通临时停市、港股通交易每日额度或总额度不足等特殊情况，组合证券的代理买入及结算价格可依次顺延至下一港股通交易日直至交易正常。如遇证券长期停牌、流动性不足等可能导致收盘价或最后成交价不公允的特殊情况，可参照证券的估值价格，对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护持有人利益，该证券对应的现金替代款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。 对于成分证券中深圳交易所、上海交易所上市的股票，在T日后被替代的成份证券有正常交易的1个交易日（简称为T+1日）内，基金管理人有权在任意时刻以收到的替代金额代投资者买入小于等于被替代证券数量的任意数量的被替代证券。 T＋1日日终，若基金管理人已购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（包括买入价格和交易费用）的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项；若基金管理人未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券的实际买入成本加上按照T＋1日收盘价计算的未购入部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。 特殊情况：若自T日起，相关证券交易所正常交易日已达20日而该部分证券的正常交易日低于2日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券的实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。 T＋1日后（在特殊情况下则为T日起的第21个交易日后），基金管理人将应退款和应补款的明细及汇总数据通过登记机构发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收，将于此后1个工作日内完成，登记机构对此提供代收代付服务。 4）赎回对应的替代金额 赎回时，对于可以现金替代的证券，替代金额为扣除相关费用后的该证券的卖出价值（或证券实际结算价值） 5）赎回替代金额的处理程序 对于成分证券中港股通标的的股票，T+1日（指开放日）基金管理人根据赎回规模进行组合证券的代理卖出。 T+1日（指开放日）日终，基金管理人根据所卖出的被替代证券的实际单位卖出金额（扣除相关费用）和未卖出的被替代证券的T+1日（指开放日）收盘价（折算为人民币，折算汇率采用当天的估值汇率；被替代证券T+1日（指开放日）在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价）计算被替代证券的单位结算金额，在此基础上根据替代证券数量确定赎回替代金额。在此期间若该部分证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。现金赎回替代款的清算交收由基金管理人和申购赎回代理券商协商处理，正常情况下，该款项的清算交收于T+7日（指开放日）内办理，但如果出现港股通暂停交易或交收、流动性不足等原因导致无法足额卖出，则该款项的清算交收可延迟办理。 如遇港股通临时停市等特殊情况，组合证券的代理卖出及结算价格可依次顺延至下一港股通交易日直至交易正常。如遇证券长期停牌、流动性不足等可能导致收盘价或最后成交价不公允的特殊情况，可参照证券的估值价格，对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护持有人利益，该证券对应的现金替代款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理，在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。 对于成分证券中深圳交易所、上海交易所上市的股票，在T日后被替代的成份证券有正常交易的1个交易日（简称为T+1日）内，基金管理人有权在任意时刻代投资者卖出小于等于被替代证券数量的任意数量的被替代证券。 T＋1日日终，若基金管理人已卖出全部被替代的证券，则以被替代证券的实际卖出金额（扣减交易费用后），确定基金应退还投资人的款项；若基金管理人未能卖出全部被替代的证券，则以被替代证券卖出部分的实际卖出金额加上按照T＋1日收盘价计算的未卖出部分被替代证券价值，确定基金应退还投资人的款项。 特殊情况：若自T日起，相关证券交易所正常交易日已达20日而该部分证券的正常交易日低于2日，则以被替代证券卖出部分的实际卖出金额加上按照最近一日收盘价计算的未卖出部分被替代证券价值，确定基金应退还投资人的款项。 T＋1日后（在特殊情况下则为T日起的第21个交易日后），基金管理人将应退款的明细及汇总数据通过登记机构发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收，将于此后1个工作日内完成，登记机构对此提供代收代付服务。	（2）可以现金替代 可以现金替代的组合证券分为：深市成份证券和非深市成份证券。 1）对于深市成份证券 ①适用情形：投资者申购时持仓不足的深市成份证券。登记结算机构先用深市成份证券，不足时差额部分用现金替代。 ②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为： 替代金额＝替代证券数量×该证券开盘参考价格×（1＋现金替代溢价比例） 其中，“该证券开盘参考价格”为该证券经除权调整的T−1日收盘价。如果深圳证券交易所参考价格确定原则发生变化，以深圳证券交易所通知规定的参考价格为准。 收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券正常交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。 ③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现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。 在T日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日（简称为N+2日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。N＋2日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照N+2日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。 特例情况：若自T日起，深圳证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于2日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。 若现金替代日（T日）后至N+2日（若在特例情况下，则为T日起第20个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。 N+2日后第1个工作日（若在特例情况下，则为T日起第21个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理机构和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。 ④替代限制：为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，基金管理人可规定投资者使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为： 现金替代比例（%）  说明：假设当天可以现金替代的股票只数为n。 “T−1日基金份额净值”目前为本基金前一交易日除权除息后的收盘价。 如果深圳证券交易所现金替代比例计算公式发生变化，以深圳证券交易所通知规定的为准。 2）对于非深市成份证券 A、对于沪市成份证券 ①适用情形：投资者申购和赎回时的沪市成份证券。登记结构机构对设置可以现金替代的沪市成份证券全部用现金替代。 ②替代金额：对于可以现金替代的沪市成份证券，替代金额的计算公式为： 申购替代金额＝替代证券数量×该证券开盘参考价格×（1+现金替代溢价比例） 赎回替代金额＝替代证券数量×该证券开盘参考价格×（1−现金替代折价比例） 其中，“该证券开盘参考价格”为该证券经除权调整的T−1日收盘价。如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。 申购时收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将买入该证券，实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取申购替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。 赎回时扣除现金替代折价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将卖出该证券，实际卖出价格扣除相关交易费用后与赎回时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代折价比例，并据此支付赎回替代金额。如果预先支付的金额低于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将退还少支付的差额；如果预先支付的金额高于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将向投资者收取多支付的差额。 ③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现金替代溢价比例和现金替代折价比例，并据此收取申购替代金额和支付赎回替代金额。 基金管理人将自T日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的部分证券。T日未完成的交易，基金管理人在T日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日（简称为N+2日）内完成上述交易。 时间优先的原则为：申购赎回方向相同的，先确认成交者优先于后确认成交者。先后顺序按照深交所确认申购赎回的时间确定。 实时申报的原则为：基金管理人在上交所连续竞价期间，根据收到的深交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向上交所申报被替代证券的交易指令。 基金管理人按照“时间优先”的原则依次与申购投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照申购确认时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；按照“时间优先”的原则依次与赎回投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照赎回确认时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。 对于T日因停牌或流动性不足等原因未购入和未卖出的被替代部分证券，T日后基金管理人可以继续进行被替代证券的买入和卖出，按照前述原则确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。 N+2日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照N+2日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项。 N+2日日终，若已卖出全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项；若未能卖出全部被替代的证券，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照N+2日收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。 特例情况：若自T日起，上海证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于2日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。 若现金替代日（T日）后至N+2日（若在特例情况下，则为T日起第20个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。 N+2日后第1个工作日（若在特例情况下，则为T日起第21个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。 B、对于港交所成份证券 ①申购时，申购替代金额的计算公式为： 申购替代金额=证券数量×该证券T日预计开盘价×T−1日估值汇率×（1＋现金替代溢价比例）。 T日预计开盘价为经除权调整的T−1日收盘价或基金管理人认为合理的其他价格。 收取现金替代溢价的原因是，基金的实际买入价格（或证券实际结算价格）加上相关交易费用后与申购时证券的预计开盘价可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。基金管理人根据市场情况和实际需要确定和调整现金替代溢价比例，具体的现金替代溢价比例以申购赎回清单公告为准。 申购时，如果预先收取的金额高于基金买入证券的实际成本（或证券实际结算成本），则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金买入证券的实际成本（或证券实际结算成本），则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。 ②申购替代金额的处理程序 对于确认成功的T日申购申请，对于组合证券中需要代为买入的港股，基金管理人将在T日买入申购被替代的部分证券。在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。 正常情况下，T+5日（指开放日）内，基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。 如遇港股通临时停市、港股通交易每日额度或总额度不足等特殊情况，组合证券的代理买入或卖出及结算价格可依次顺延至下一港股通交易日直至交易正常，款项交收的日期也顺延。若发生特殊情况，基金管理人可以对以上交收日期进行相应调整。如遇证券长期停牌、流动性不足等可能导致最后成交价或收盘价不公允的特殊情况，可参照证券的估值价格，对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护持有人利益，该证券对应的现金退补款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。 ③赎回对应的现金替代款 赎回时，现金替代款为扣除相关费用后的该证券的卖出金额（或证券实际结算价值） 对于确认成功的T日赎回申请，对于组合证券中需要代为卖出的港股，基金管理人在T日卖出赎回被替代的部分证券。在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）按照汇率折算后的金额，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。 正常情况下，T+5日（指开放日）内，基金管理人将赎回现金替代的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。 如遇港股通临时停市、港股通交易每日额度或总额度不足等特殊情况，组合证券的代理卖出及结算价格可依次顺延至下一港股通交易日直至交易正常，款项交收的日期也顺延。若发生特殊情况，基金管理人可以对以上交收日期进行相应调整。如遇证券长期停牌、流动性不足等可能导致最后成交价或收盘价不公允的特殊情况，可参照证券的估值价格，对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护持有人利益，该证券对应的赎回现金替代款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。 ④基金管理人有权根据实际情况对上述申购和赎回的现金替代处理程序进行调整，并在正式实施前在规定媒介公告。
第十一部分基金份额的申购与赎回	4.预估现金部分相关内容 …… T日申购赎回清单中公告T日预估现金部分，其计算公式为： T日预估现金部分＝T－1日最小申购赎回单位的基金资产净值－（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成份证券的数量与该证券调整后T日开盘参考价相乘（若为港股通标的股票，则还需与T－1日估值汇率相乘）之和） 其中，该证券调整后T日开盘参考价主要根据恒生指数公司提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。…	4.预估现金部分相关内容 …… T日申购赎回清单中公告T日预估现金部分，其计算公式为： T日预估现金部分＝T－1日最小申购赎回单位的基金资产净值－（申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额总额＋申购赎回清单中各A股可以用现金替代成份证券的数量与该证券调整后T日开盘参考价相乘之和＋申购赎回清单中港股可以现金替代的成份证券的数量，T日预估开盘价以及T－1日估值汇率的乘积之和＋申购赎回清单中各禁止现金替代成份证券的数量与相应证券调整后T日开盘参考价相乘之和） 其中，该证券调整后T日开盘参考价和T日预估开盘价主要根据恒生指数公司提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。…
第十一部分基金份额的申购与赎回	5、现金差额相关内容 …… T日现金差额在T＋1日的申购赎回清单中公告，其计算公式为： T日现金差额＝T日最小申购赎回单位的基金资产净值－（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T日收盘价相乘积（若为港股通标的股票，则还需与T日估值汇率相乘）之和）	5、现金差额相关内容 …… T日现金差额在T＋1日的申购赎回清单中公告，其计算公式为： T日现金差额＝T日最小申购赎回单位的基金资产净值－（申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额总额＋申购赎回清单中各A股可以用现金替代的所有成份证券的数量与其T日收盘价相乘之和＋申购赎回清单中港股可以现金替代的成份证券的数量、T 日收盘价以及T日估值汇率的乘积之和＋申购赎回清单中各禁止现金替代成份证券的数量与相应证券调整后T日收盘价相乘之和）
	6、申购赎回清单的格式 调整申赎清单模板，删除原表格	6、申购赎回清单的格式 申购、赎回清单的格式举例如下：  说明：（1）此表仅为示例。 （2）现金替代折价比例字段仅适用于现金替代标志为“允许”的沪市成份证券。 若深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购赎回清单的格式进行调整，基金管理人将视情况对相关格式进行相应的调整，并依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。
	十六、其他 1、未来在深圳证券交易所和登记机构系统允许的情况下，在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经履行相关程序后，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资人集合其持有的组合证券共同构成最小申购赎回单位或其整数倍进行申购。基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则。	十六、其他 1、未来在深圳证券交易所和登记机构系统允许的情况下，在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经履行相关程序后，基金管理人可开放集合申购（或集中申购，业务名称以深圳证券交易所业务规则为准），即允许多个投资人集合其持有的组合证券共同构成最小申购赎回单位或其整数倍进行申购。基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则。
第十九部分风险揭示	九、投资人申购失败的风险 本基金申购对价目前包括现金替代、现金差额及其他对价，未来可能包含组合证券。届时如投资人提交实物申购申请，由于本基金的实物申购赎回清单中，可能仅允许对部分成份股使用现金替代，且设置现金替代比例上限，因此，投资人在进行场内份额申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致场内份额申购失败的风险。	九、投资人申购失败的风险 本基金的实物申购赎回清单中，可能仅允许对部分成份股使用现金替代，且设置现金替代比例上限，因此，投资人在进行场内份额申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致场内份额申购失败的风险。
	十一、基金场内份额赎回对价的变现风险 本基金赎回对价目前包括现金替代、现金差额及其他对价，未来可能包含组合证券。在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资人变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。	十一、基金场内份额赎回对价的变现风险 本基金赎回对价包括组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资人变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金2020年12月24日、2020年12月25日暂停申购、赎回的公告

公告送出日期：2020年12月21日

1.公告基本信息

基金名称	博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金	
基金简称	博时大湾区ETF	
基金主代码	159809	
基金管理人名称	博时基金管理有限公司	
公告依据	《博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》等	
暂停相关业务的起始日及原因说明	暂停申购起始日	2020年12月24日
	暂停赎回起始日	2020年12月24日
	暂停申购、赎回的原因说明	根据《关于2019年底及2020年深港通下的港股通交易日安排的通知》及《关于博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金调整申购赎回规则并相应修改基金合同和招募说明书的公告》的相关安排，保护现有基金份额持有人的利益，保障基金平稳运作。

注：根据中国创盈市场服务有限公司《关于2019年底及2020年深港通下的港股通交易日安排的通知》，2020年12月24日下午至2020年12月25日不提供港股通服务。

2、其他需要提示的事项

（1）根据《博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金管理人决定于2020年12月24日暂停本基金的申购、赎回业务，并自2020年12月28日起恢复本基金的上述业务，届时不再另行公告。投资者在2020年12月24日、2020年12月25日仍可进行本基金的二级市场交易。

（2）若港股通交易日安排、深圳证券交易所、香港联合交易所有限公司状况等发生变化，或根据法律法规、基金合同等规定需要调整上述事项的，或中国证监会、证券交易所发布新一年度节假日放假和休市安排影响本基金申赎等业务办理的，本公司将及时公告相关业务安排。为避免因非港股通交易日原因带来的不便，敬请投资者提前进行相关业务安排。

（3）如有疑问，请拨打博时一线通：95105568（免长途话费）或登录本公司网站www.bosera.com获取相关信息。

特此公告。

博时基金管理有限公司
2020年12月21日

博时弘盈定期开放混合型证券投资基金A类基金份额溢价风险提示及停复牌公告

近期，博时基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）旗下博时弘盈定期开放混合型证券投资基金A类基金份额（场内简称：弘盈A；交易代码：160520）在二级市场的交易价格出现大幅度溢价，交易价格明显偏离基金份额净值。2020年12月18日，弘盈A二级市场收盘价为1.653元，相对于当日基金份额参考净值溢价幅度超过30%，明显高于基金份额参考净值，投资者如果盲目追高，可能遭受重大损失。

为了保护基金份额持有人的利益，并根据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的相关规定，弘盈A将于2020年12月21日开市起至当日10:30停牌，2020年12月21日10:30复牌。

特此提醒投资者密切关注基金份额净值，注意投资风险。本基金管理人提示如下：

1、弘盈A已开通系统内转托管和跨系统转托管业务，投资者可自由将弘盈A场外份额转至场内。如投资者将其持有的弘盈A场外份额转至场内，并在二级交易市场卖出，因场内份额的增多，弘盈A的在场内的交易溢价可能出现大幅收窄，交易价格贴近基金份额净值的水平。如有场内投资者在弘盈A溢价时买入，将可能承担由于交易价格贴近基金份额净值而带来的损失，特别提请投资者关注此风险。

2、博时弘盈定期开放混合型证券投资基金当前封闭期为自2019年9月10日至2021年3月9日，本基金将于2021年3月10日进入开放期。开放期内，弘盈A的申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类别基金份额净值为基准计算，与弘盈A的二级市场交易价格无关。

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金品种。投资者投资本基金时应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

3、弘盈A的交易价格，除了有份额净值变化的风险外，还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响，在当前溢价水平下买入，可能使投资人面临重大损失。

4、截至本公告披露日，博时弘盈定期开放混合型证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

5、截至本公告披露日，博时弘盈定期开放混合型证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求，及时做好信息披露工作。

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。投资者投资于本基金前应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。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

博时基金管理有限公司
2020年12月21日

证券代码：002869　　证券简称：金溢科技　　公告编号：2020-125

深圳市金溢科技股份有限公司关于公司日常经营重大合同履行进展的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、合同概述

深圳市金溢科技股份有限公司（以下简称“公司”）与山东高速信联支付有限公司（以下简称“信联支付”）于2019年签署了《车载电子标签（OBU）供货协议》，根据协议约定的供货计划，公司应当在2019年7-9月向信联支付供应指定型号的蓝牙ETC车载电子标签（OBU）不少于895万台。如公司产品供货时间、供货数量违反协议约定的，公司将按每片50元×未到货数量对信联支付进行赔偿。具体情况详见公司于2019年9月2日披露的《关于公司签署日常经营重大合同的公告》（公告编号：2019-088）。

二、合同履行进展情况

近日，信联支付与公司就协议履行过程中供货完成情况进行核对，双方确认公司有85.63万台OBU的供货时间晚于协议约定时间。

三、对上市公司的影响

根据此前公司与信联支付签订的协议，上述供货逾期将导致公司面临赔偿风险。如信联支付要求公司针对供货逾期予以赔付，可能形成的最大赔偿金额预计为4,281.50万元。

根据《企业会计准则第13号——或有事项》的规定，上述情形符合确认预计负债的条件，将导致公司本年度利润表增加营业外支出4,281.50万元，资产负债表增加预计负债4,281.50万元，扣除企业所得税的影响后，预计减少归属于母公司所有者的净利润3,639.28万元，对公司未来各会计年度财务状况、经营成果无影响。

目前双方正就上述事项进行协商，尚未对具体解决方案达成最终意见，上述事项不会对公司与信联支付的友好合作关系产生重大影响。公司将及时披露该事项进展情况。敬请广大投资者谨慎决策，注意投资风险。

四、备查文件

1、《车载电子标签（OBU）供货协议2019年供货明细表》。

特此公告。

深圳市金溢科技股份有限公司董事会
2020年12月21日

证券代码：002869　　证券简称：金溢科技　　公告编号：2020-126

深圳市金溢科技股份有限公司股东股份质押的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

深圳市金溢科技股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）近日接到股东李娜女士通知，获悉李娜女士所持有本公司的部分股份办理了质押手续。李娜女士及其一致行动人王明宽先生、李朝莉女士为公司合计持股5%以上股东，具体事项如下：

一、股东股份质押基本情况

1、本次股份质押基本情况

单位：万股

股东名称	是否为控股股东或第一大股东及其一致行动人	质押数量	占其所持股份比例	占公司总股本比例	是否为限售股	是否为补充质押	质押开始日期	质押到期日期	质权人	质押用途
李娜	否	61.00	9.67%	0.34%	否	是	2020年12月17日	2021年7月29日	国泰君安证券股份有限公司	补充质押
合计	-	61.00	9.67%	0.34%	-	-	-	-	-	-

上述质押股份不存在负担重大资产重组等业绩补偿义务。

2、股东股份累计质押基本情况

截至公告披露日，股东李娜女士及其一致行动人所持质押股份情况如下：

单位：万股

股东名称	持股数量	持股比例	本次质押前质押股份数量	本次质押后质押股份数量	占其所持股份比例	占公司总股本比例	已质押股份情况		未质押股份情况	
							已质押股份限售和冻结数量	占已质押股份比例	未质押股份限售和冻结数量	占未质押股份比例
王明宽	809.73	4.48%	252.00	252.00	31.12%	1.40%	0	0.00%	0	0.00%
李娜	631.00	3.49%	330.00	391.00	61.97%	2.16%	0	0.00%	0	0.00%
李朝莉	90.15	0.50%	0.00	0.00	0.00%	0.00%	0	0.00%	0	0.00%
合计	1,530.88	8.47%	582.00	643.00	42.00%	3.56%	0	0.00%	0	0.00%

二、其他情况说明

1、股东股份被冻结、拍卖或设定信托基本情况

截至公告披露日，股东李娜女士及其一致行动人王明宽先生、李朝莉女士未发生股份被冻结、拍卖或设定信托的情况。

2、股份质押风险

截至公告披露日，股东李娜女士及其一致行动人王明宽先生、李朝莉女士累计质押股份数量占公司总股本的比例为3.56%，该比例仍在合理范围内。针对部 分股东质押比例较高的问题，公司已向其做出充分的风险提示，若股价跌至质押 业务警戒线，该部分股东将通过部分偿还本金、补充质押股票，或提前解除质押 等方式，避免出现质押股份被强制平仓的情形。

3、本次股份质押不属于《关于上市公司限售股份、解除限售存量股份参与融资融券交易相关问题的通知》（深证会〔2013〕30号）规定的“接受上市公司的董事、监事、高级管理人员、持有上市公司百分之五以上的股东开展以该上市公司股票为标的证券的融资融券交易”的情形。

4、本次股份变动未达到《证券法》、《上市公司收购管理办法》等规定的相关情形。

三、备查文件

1、股份质押登记证明；

2、中国证券登记结算有限责任公司股份冻结明细；

3、深交所要求的其他文件。

深圳市金溢科技股份有限公司董事会
2020年12月21日