

**博时标普 500 交易型开放式指数证券投资
资基金
2019 年第 4 季度报告
2019 年 12 月 31 日**

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年一月十七日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 1 月 15 日复核了本报告中的财务指标、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。

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。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	博时标普 500ETF
场内简称	标普 500
基金主代码	513500
交易代码	513500
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2013 年 12 月 5 日
报告期末基金份额总额	700,819,285.00 份
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。
投资策略	本基金主要采取完全复制法实现对标的指数的紧密跟踪。同时，为了更好地实现本基金的投资目标，本基金可适当借出证券。为了减轻由于现金拖累产生的跟踪误差，本基金将用少量资产投资跟踪同一标的指数的股指期货，以达到最有效跟踪标的指数的投资目标。
业绩比较基准	标普 500 指数（S&P 500 Index（NTR，Net total Return））（经估值汇率调整，以人民币计价）
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，属于高预期风险和高预期收益的基金品种。本基金主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数相似。本基金主要投资于美国证券市场的股票，投资者需承担汇率风险。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	Brown Brothers Harriman Co.
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼银行

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2019 年 10 月 1 日-2019 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	9,018,662.23
2.本期利润	85,123,980.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.1424
4.期末基金资产净值	1,477,921,261.68
5.期末基金份额净值	2.1088

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

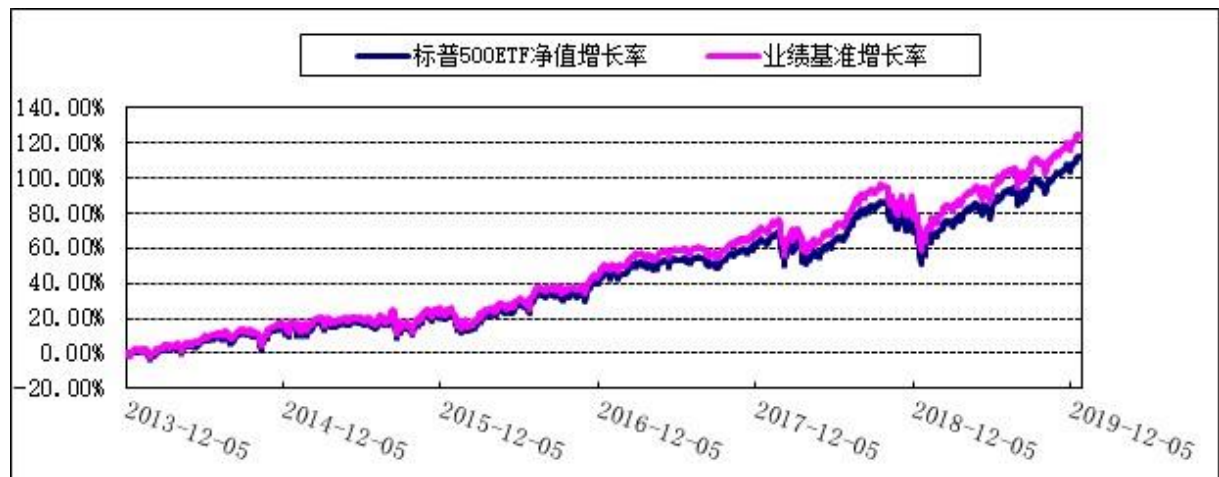
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①-③	②-④
过去三个月	7.17%	0.59%	7.42%	0.59%	-0.25%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来 基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

万琼	基金经理	2015-10-08	-	12.8	<p>万琼女士，硕士。2004年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2017年9月29日-2019年9月5日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015年6月8日-2019年10月11日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015年6月8日-2019年10月11日)的基金经理。现任博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015年6月8日—至今)、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2015年6月8日—至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2015年10月8日—至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015年10月8日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(2019年8月1日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2019年12月30日—至今)的基金经理。</p>
汪洋	指数与量化投资部副总经理/基金经理	2016-05-16	-	10.6	<p>汪洋先生，硕士。2009年起先后在华泰联合证券、华泰柏瑞基金、汇添富基金工作。2015年加入博时基金管理有限公司。历任指数投资部总经理助理、指数投资部副总经理。现任指数与量化投资部副总经理兼博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2016年5月16日—至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2016年5月16日—至今)、博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金(2016年5月16日—至今)、博时标普</p>

					500 交易型开放式指数证券投资基金(2016 年 5 月 16 日—至今)的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 52 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年 4 季度，美股大幅上涨，风险偏好提升。从经济基本面上来看，美国劳动力市场稳健，经济向好。11 月就业数据明显好于预期，就业仍有韧性。11 月新增非农就业人数为 26.6 万，超出市场预期 18.3 万，且是 2019 年以来有 6 个月就业数据上调。美国房地产市场有所回升，但长期需求量仍需关注。美国 11 月新屋销售超预期，房地产市场相对之前有较大幅度回暖。长期来看住房市场需求量或将成为拖累。美国耐用品需求下降，制造业回升面临压力。11 月耐用品订单环比本期值为 -2%，上期值为 0.2%，不及预期。第 4 季度商业投资可能仍将拖累经济增长。从货币政策方面来看，10 月议息会议降息 1 次，12 月议息会议暂停降息，基本符合市场预期。美联储的降息周期暂停难言结束。从市场情绪上来看，4 季度美股连续上涨，市场情绪有所修复。

展望 2020 年 1 季度，美国经济基本面大概率向好。美国经济增长依然稳定，劳动力市场稳健，房地产市场仍在缓慢恢复，制造业修复及补库存或对经济形成边际提振，短期居民消费尚可或将维持温和扩张态势。主要风险因素在于两个方面，一方面是美伊冲突升温，中东地缘政治风险加剧；另一方面是中美贸易战的演变。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 2.1088 元，份额累计净值为 2.1088 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 7.17%，同期业绩基准增长率 7.42%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,386,339,745.15	92.30
	其中：普通股	1,346,782,273.01	89.66
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	39,557,472.14	2.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	111,040,331.18	7.39
8	其他各项资产	4,643,905.04	0.31
9	合计	1,502,023,981.37	100.00

注：金融衍生品投资项下的期货投资，在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货结算暂收款（结算所得的持仓损益）相抵消后的净额为 0，具体投资情况详见下表：

期货类型	期货代码	期货名称	持仓量 (买/卖)	合约价值 (人民币元)	公允价值变动 (人民币元)
股指期货	ESHO	S&P500 EMINI FUT Mar20	76.00	85,655,039.32	1,763,269.43
总额合计					1,763,269.43
减：可抵消期货 暂收款					1,763,269.43
股指期货投资净 额					0.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
--------	------------	--------------

美国	1,386,339,745.15	93.80
合计	1,386,339,745.15	93.80

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	60,329,588.52	4.08
原材料	35,191,368.24	2.38
工业	125,629,816.64	8.50
非日常生活消费品	135,244,025.17	9.15
日常消费品	99,991,043.25	6.77
医疗保健	197,147,627.74	13.34
金融	179,778,701.50	12.16
信息技术	322,030,489.97	21.79
电信业务	144,252,951.67	9.76
公用事业	46,122,435.35	3.12
房地产	40,621,697.10	2.75
合计	1,386,339,745.15	93.80

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	APPLE INC	苹果	AAPL US	纳斯达克交易所	美国	31,062.00	63,632,405.82	4.31
2	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克交易所	美国	56,735.00	62,416,825.29	4.22
3	ALPHABET INC-CL A	谷歌	GOOGL US	纳斯达克交易所	美国	2,228.00	20,818,103.41	1.41
	ALPHABET INC-CL C		GOOG US	纳斯达克交易所	美国	2,222.00	20,725,302.65	1.4
4	AMAZON.COM INC	亚马逊	AMZN US	纳斯达克交易所	美国	3,097.00	39,923,121.66	2.7
5	FACEBOOK INC-CLASS A	脸书	FB US	纳斯达克交易所	美国	17,897.00	25,626,088.80	1.73
6	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	伯克希尔·哈撒韦	BRK/B US	纽约证券交易所	美国	14,547.00	22,985,849.99	1.56
7	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	JPM US	纽约证券交易所	美国	23,326.00	22,684,121.66	1.53
8	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	纽约证券交易所	美国	19,573.00	19,917,842.87	1.35
9	VISA INC-CLASS A SHARES	维萨	V US	纽约证券交易所	美国	12,731.00	16,688,151.01	1.13
10	PROCTER & GAMBLE CO/THE	保洁	PG US	纽约证券交易所	美国	18,546.00	16,159,637.59	1.09

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	期货投资	S&P500 EMINI FUT Mar20	1,763,269.43	0.12

5.9 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基金投资明细

本基金本期末未持有基金投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	3,340,204.56
2	应收证券清算款	94,660.46
3	应收股利	1,202,281.17
4	应收利息	6,758.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,643,905.04

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	579,819,285.00
报告期基金总申购份额	170,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	49,000,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	700,819,285.00

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金		2019 年 10 月 1 日至 2019 年 12 月 30 日	379,399,160.00	117,000,000.00	15,800,000.00	480,599,160.00	68.58%
产品特有风险							
本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20% 的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，							

未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2019 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 199 只开放式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 10668 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 3270 亿元人民币，累计分红逾 1206 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2019 年 4 季末：

博时旗下权益类基金业绩表现优异，70 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）2019 年净值增长率超过 30%，38 只产品净值增长率超过 40%，10 只产品净值增长率超过 60%，4 只产品净值增长率超过 80%，2 只产品净值增长率超过 90%；从相对排名来看，62 只产品 2019 年净值增长率银河证券同类排名在前 1/2，32 只产品同类排名在前 1/4，13 只产品同类排名在前 10，2 只产品同类排名第 1。

其中，博时回报混合、博时医疗保健混合 2019 年净值增长率双双同类排名第 1，博时弘泰定期开放混合、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(C 类) 同类排名第 2，博时文体娱乐主题混合、博时丝路主题股票(C 类)、博时乐臻定期开放混合、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(A 类)、博时弘盈定期开放混合(C 类)、博时特许价值混合(A 类)、博时中证银联智惠大数据 100 指数(C 类)、博时量化平衡混合、博时中证淘金大数据 100 指数(I 类)同类排名分别为第 4、第 4、第 7、第 7、第 7、第 8、第 8、第 10、第 10，博时睿利事件驱动灵活配置混合(LOF)、博时鑫泽灵活配置混合(C 类)、博时裕益灵活配置混合同类排名均在前 1/10，博时鑫源灵活配置混合(C 类)、博时厚泽回报灵活配置混合(C 类)、博时互联网主题灵活配置混合、博时新兴消费主题混合、博时沪港深优质企业灵活配置混合(C 类)、博时鑫泽灵活配置混合(A 类)、博时鑫源灵活配置混合(A 类)、博时创新驱动灵活配置混合(C 类)、博时颐泰混合(A 类)、博时新起点灵活配置混合(C 类)、博时新兴成长混合、博时颐泰混合(C 类)、博时新起点灵活配置混合(A 类)、博时厚泽回报灵活配置混合(A 类)、博时鑫瑞灵

活配置混合(C类)、博时战略新兴产业混合、博时睿远事件驱动灵活配置混合(LOF)、博时沪港深优质企业灵活配置混合(A类)、博时策略灵活配置混合等产品 2019 年来净值增长率同类排名均在前 1/4。此外,博时裕隆灵活配置混合、博时主题行业混合(LOF)、博时汇智回报灵活配置混合、博时外延增长主题灵活配置混合、博时产业新动力灵活配置混合(A类)等产品不仅 2019 年业绩表现较好,成立以来年化回报亦可观,长期投资价值凸显。

博时固定收益类基金表现同样可圈可点,67 只产品(各类份额分开计算,不含 QDII,下同)2019 年净值增长率超过 4%,19 只产品净值增长率超过 6%,8 只产品净值增长率超过 10%,2 只产品净值增长率超过 30%;从相对排名来看,68 只产品 2019 年净值增长率银河证券同类排名在前 1/2,40 只产品同类排名在前 1/4,18 只产品同类排名在前 1/10,6 只产品同类排名前 5,1 只产品同类排名第 1。

其中,博时安康 18 个月定期开放债券(LOF)2019 年净值增长率同类排名第 1,博时安盈债券(A类)、博时安盈债券(C类)、博时月月薪定期支付债券、博时转债增强债券(C类)、博时安心收益定期开放债券(C类)同类排名分别在第 2、第 3、第 4、第 4、第 5,博时富瑞纯债债券(A类)、博时转债增强债券(A类)、博时信用债券(C类)、博时安心收益定期开放债券(A类)、博时裕顺纯债债券、博时合惠货币(B类)、博时信用债券(A/B类)同类排名分别在第 6、第 6、第 7、第 8、第 9、第 9、第 9,博时裕腾纯债债券、博时裕泰纯债债券、博时岁岁增利一年定期开放债券、博时裕创纯债债券、博时裕盈纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时富祥纯债债券、博时富兴纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时信用债纯债债券(A类)、博时信用债纯债债券(C类)同类排名均在前 1/10,博时稳健回报债券(LOF)(C类)、博时合惠货币(A类)、博时裕安纯债债券、博时稳健回报债券(LOF)(A类)、博时合鑫货币、博时聚瑞纯债 6 个月定期开放债券发起式、博时现金宝货币(B类)、博时现金宝货币(A类)、博时外服货币、博时富业纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时安丰 18 个月定期开放债券(A类-LOF)、博时裕盛纯债债券、博时富腾纯债债券、博时天颐债券(A类)、博时宏观回报债券(A/B类)、博时安瑞 18 个月定期开放债券(A类)、博时天颐债券(C类)、博时安泰 18 个月定期开放债券(A类)、博时宏观回报债券(C类)、博时景兴纯债债券、博时裕达纯债债券等产品同类排名均在前 1/4。

博时旗下 QDII 基金继续表现突出,博时标普 500ETF、博时标普 500ETF 联接(C类)、博时标普 500ETF 联接(A类)2019 年净值增长率分别超过或接近 30%,同类排名分别为第 4、第 6、第 14;博时亚洲票息收益债券(人民币)2019 年净值增长率超过 10%,同类排名第 7。

商品型基金当中,博时黄金 ETF、博时黄金 ETF 联接(A类)、博时黄金 ETF 联接(C类)2019 年均较好地跟上了黄金上涨行情,净值增长率均超过 18%,其中博时黄金 ETF 净值增长率同类排名第 3。

2、其他大事件

2019 年 12 月 26 日,界面新闻在京举办“2019 中国优金融奖”颁奖盛典,博时基金凭借“政策响应、行业领先、实体支持、创新赋能”等方面的综合卓越表现,荣获“年度基金公司”大奖以及“2019 中国好品牌”。

2019 年 12 月 21 日，和讯网“第十七届财经风云榜金融峰会”在上海举办，博时基金荣获“年度卓越影响力基金公司”，博时基金葛晨获“年度卓越公募基金经理”。

2019 年 12 月 20 日，华夏时报“华夏机构投资者年会暨第十三届金蝉奖颁奖典礼”在北京举办。博时基金荣获“年度投研领先公募基金公司”。

2019 年 12 月 12 日，投资者网“2019 中国投资年度排名颁奖典礼”在上海隆重举行。博时基金荣获“年度值得信任卓越基金公司”。

2019 年 12 月 10 日，投资时报“见未来”——2019 第二届资本市场高峰论坛暨金禧奖年度颁奖盛典在京举办，博时基金荣获投资时报颁发的 2019 年度金禧奖“2019 最佳公募基金公司奖”。

2019 年 12 月 5 日，金融界“大变局·大视野·大未来”——第四届智能金融国际论坛暨 2019 金融界“领航中国”年度盛典在北京举行，博时基金斩获四项大奖，博时基金荣获“杰出年度基金公司奖”，凭借在金融科技方面的杰出贡献，获得“杰出年度智能金融品牌奖”，博时基金总经理江向阳荣获“杰出年度基金领袖奖”，博时基金王俊荣获“杰出年度基金经理奖”。

2019 年 12 月 5 日，21 世纪财经“金帆奖”颁奖典礼在广州举行，博时基金凭借在业内所取得的突出成就与贡献，获得“2019 年度基金管理公司金帆奖”。

2019 年 11 月 29 日，《经济观察报》在北京举办了“卓越金融企业”颁奖典礼，博时基金荣获“年度卓越综合实力基金公司”奖项。

2019 年 11 月 29 日，北京商报“寻路未来金融”——2019 年度北京金融论坛在京举办，博时基金凭借优秀的投研能力及全面的产品布局，荣获“北京金融业十大金融品牌——产品创新奖”。

2019 年 11 月 28 日，新浪财经 2019 新浪金麒麟论坛·ESG 峰会在北京举办，会上公布了 2019 中国企业 ESG“金责奖”评选名单，意在嘉奖那些对中国 ESG 事业做出卓越贡献的企业和机构，博时基金荣获 2019 中国企业 ESG 金责奖——“责任投资最佳基金公司奖”。

2019 年 11 月 22 日，2019 年度中国金融发展论坛暨金鼎奖颁奖典礼在北京举行，在资产管理领域甄选出了一批优质的标杆企业。群雄逐鹿百舸争流，博时基金跻身新资管时代的佼佼者，成功斩获“普惠金融奖”和“最佳海外固收产品奖”两项荣誉。

2019 年 11 月 15 日，中国经济网“2019 中国金融服务于创新论坛”在北京举办，博时基金荣获“金融服务 100 强”及“金融创新 100 强”称号。

2019 年 11 月 15 日，2019 年度第一财经金融价值榜（CFV）颁奖典礼在上海举行，博时基金凭借优秀的资产管理能力摘得“年度金融机构”奖项。

2019 年 11 月 9 日，人民日报社《国际金融报》和河南省商丘市人民政府共同主办的“第三届资本市场扶贫高峰论坛”在商丘市举办，博时基金荣获“年度扶贫企业奖”。

2019 年 10 月，由中国网主办的 2019 年度第二届“中国网之优秀金融扶贫先锋榜”评选活动圆满结束，经过多轮线上投票和业内专家、学者的专业评审，博时基金荣获 2019 年度第二届“中国网之优秀金融扶贫先锋榜”精准扶贫先锋机构奖项。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证监会批准标普 500 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 9.1.2 《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 9.1.5 报告期内博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二〇年一月十七日