

博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资 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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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	博时中债 1-3 年国开行	
基金主代码	007147	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 4 月 22 日	
报告期末基金份额总额	300,443,813.67 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。在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.25%，年化跟踪误差控制在 3% 以内。	
投资策略	本基金为指数型基金，采用抽样复制和动态最优化的方法为主，选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的债券，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。	
业绩比较基准	中债-1-3 年国开行债券指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金为债券型指数基金，属于中低风险收益水平，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博时中债 1-3 年国开行 A	博时中债 1-3 年国开行 C
下属分级基金的交易代码	007147	007148
报告期末下属分级基金的份额总额	300,355,085.77 份	88,727.90 份

§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)	
	博时中债 1-3 年国开行 A	博时中债 1-3 年国开行 C
1.本期已实现收益	2,244,967.17	735.81
2.本期利润	3,152,005.82	996.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0105	0.0098
4.期末基金资产净值	304,514,288.09	89,927.28
5.期末基金份额净值	1.0138	1.0135

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

1. 博时中债1-3年国开行A:

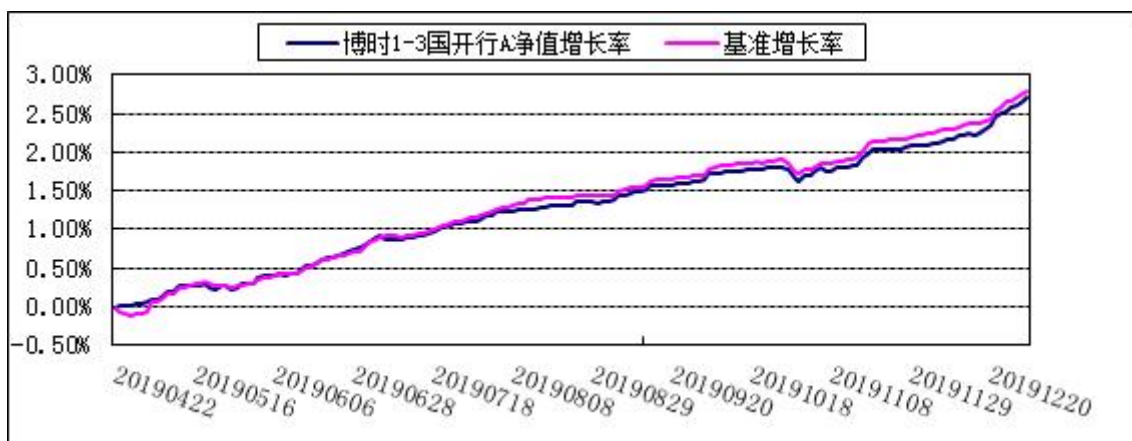
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去三 个月	1.04%	0.03%	1.07%	0.03%	-0.03%	0.00%

2. 博时中债1-3年国开行C:

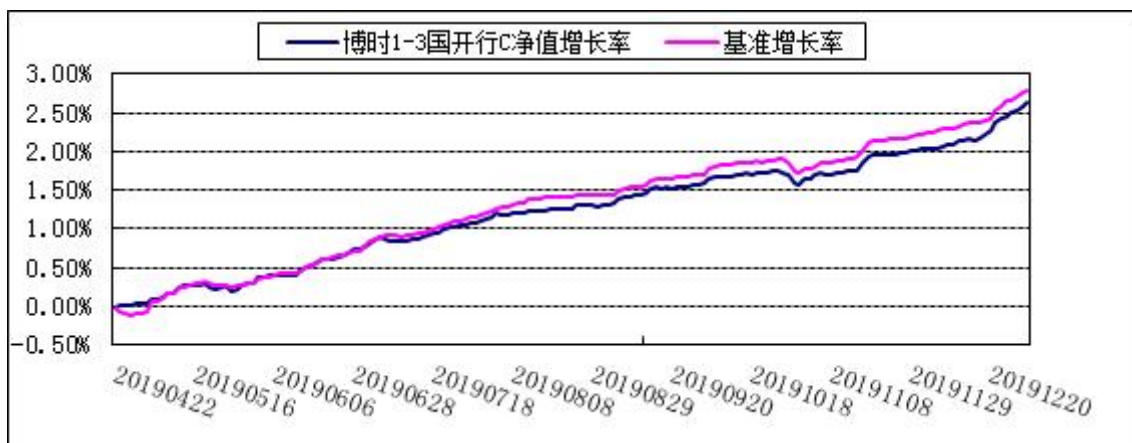
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去三 个月	1.02%	0.03%	1.07%	0.03%	-0.05%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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

1. 博时中债1-3年国开行A:



2. 博时中债1-3年国开行C:



§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		
张鹿	固定收益总部指数与创新组投资副总监/基金经理	2019-04-22	-	9.6	张鹿先生，硕士。 2010 年至 2016 年在国家开发银行工作。2017 年加入博时基金管理有限公司。曾任投资经理。现任固定收益总部指数与创新组投资副总监兼博时富鑫纯债债券型证券投资基金(2018 年 7 月 16 日—至今)、博时汇享纯债债券型证券投资基金(2018 年 11 月 6 日—至今)、博时利发纯债债券型证券投资基金(2018 年 11 月 6 日—至今)、博时景发纯债债券型证券投资基金(2018 年 11 月 19 日—至今)、博时中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金(2018 年 12 月 10 日—至今)、博时中债 3-5 年进出口行债券指数证券投资基金(2018 年 12 月 25 日—至今)、博时中债 5-10 年农发行债券指数证券投资基金(2019 年 3 月 20 日—至今)、博时中债 1-3 年国开行债券指数证

					券投资基金(2019 年 4 月 22 日—至今)、博时中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金(2019 年 7 月 19 日—至今)、博时富悦纯债债券型证券投资基金(2019 年 11 月 28 日—至今)、博时中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金(2019 年 12 月 19 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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年四季度，债券市场整体表现震荡，市场收益率先上后下，呈现倒“V”型走势。具体来看，10 月中美贸易摩擦出现阶段性缓和、英国脱欧取得实质性进展，全球避险情绪降温，风险资产迎来一波反弹。国内方面由于猪肉价格持续快速上涨引发市场不断上修通胀预期，同时由于季末效应 9 月经济金融数据也呈现一定边际向好迹象。内外部利空因素交织使得债市持续承压，长短端利率债均经历了较大调整。11 月债券市场迎来反弹，10 月的经济金融数据均大幅回落，期间央行连续下调 MLF 和 OMO 利率，货币政策宽松加码，债市收益率快速下行。12 月中美贸易谈判取得阶段性进展，11 月经济金融数据改善，风险偏好回升。但资金面宽松，市场对货币政策宽松预期强烈，配置盘买盘强劲，中短端债券收益率下行明显，长端收益率整体震荡略有下行。从指数看，四

季度中债总财富指数上涨 1.43%，中债国债总财富指数上涨 1.38%，中债企业债总财富指数上涨 1.46%，中债短融总财富指数上涨 0.85%。

本基金为被动指数债券型基金。其投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在本报告期内我们严格按照基金合同要求，力求紧密跟踪标的指数，利用多种手段尽可能减少跟踪误差。

展望后市，当前经济基本面下行压力仍大，12 月中央经济工作会议对经济形势的判断是“结构性、体制性、周期性问题相互交织，‘三期叠加’影响持续深化，经济下行压力加大”，尤其是在当前全社会债务压力较大的背景下，缺乏一个加杠杆的主体，使得经济很难出现大幅的反弹，长端利率中枢在这种背景下将趋于下行。当前长短利率债期限利差较大，10-1 年国开债利差在历史 80%分位数以上，利差保护较为充足，长端利率债大幅调整风险较小。前期市场前期对于货币政策宽松的预期打的较满，随着央行降准政策落地，短期内货币政策进一步大幅宽松的概率较小，四季度以来短端债券收益率下行较多，当前收益率已处于历史较低水平，中短端收益率下行空间已经较小，组合操作上可以锁定部分前期收益。当前货币政策定调是“保持流动性合理充裕”，货币政策的重要目标是“降低社会融资成本”，在这种背景下，很难看到货币政策的大幅紧缩。从近期政策导向看，降低银行负债端成本，疏通货币政策传导渠道，从而降低实际经济融资成本意图明显。预计未来在政策引导下，结构性存款的治理，同时银行理财的净值化转型以及银行类货币理财新规的实施，银行表内负债成本以及理财收益率下行趋势明确，这有利于银行降低负债成本，也有助于打开债券市场收益率下行的空间。整体看货币政策整体基调仍利好债市。预计一季度债券市场会延续震荡偏强格局。

投资策略上，本基金作为被动指数债券型基金，仍会以最小化跟踪误差为目标，紧密跟踪标的债券指数。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0138 元，份额累计净值为 1.0269 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0135 元，份额累计净值为 1.0261 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 1.04%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 1.02%，同期业绩基准增长率 1.07%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-

	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	294,599,134.00	96.67
	其中：债券	294,599,134.00	96.67
	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	3,073,391.44	1.01
8	其他各项资产	7,085,758.18	2.33
9	合计	304,758,283.62	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	294,599,134.00	96.72
	其中：政策性金融债	294,599,134.00	96.72
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	294,599,134.00	96.72

5.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	190202	19 国开 02	700,000	70,329,000.00	23.09
2	180203	18 国开 03	600,000	61,374,000.00	20.15
3	180212	18 国开 12	500,000	50,765,000.00	16.67
4	170206	17 国开 06	300,000	30,759,000.00	10.10
5	190207	19 国开 07	300,000	30,222,000.00	9.92

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	203.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,080,501.85
5	应收申购款	5,052.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,085,758.18

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时中债 1-3 年国开行 A	博时中债 1-3 年国开行 C
本报告期期初基金份额总额	300,530,010.59	110,414.98
报告期基金总申购份额	38,814.85	27,725.70
减：报告期基金总赎回份额	213,739.67	49,412.78
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	300,355,085.77	88,727.90

§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
机构	1	2019-10-01~2019-12-31	99,999,000.00	-	-	99,999,000.00	33.28%
	2	2019-10-01~2019-12-31	199,999,000.00	-	-	199,999,000.00	66.57%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>							

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）、博时中证银联智慧大数据 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”评选活动圆满落幕，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 中国证券监督管理委员会批准博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金设立的文件

- 9.1.2 《博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时中债 1-3 年国开行债券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 报告期内博时中债 1-3 年国开行债券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、基金托管人住所

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