

# 博时中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金

## 2020 年第 3 季度报告

### 2020 年 9 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年十月二十八日

## §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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 26 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 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	博时中证 500ETF
场内简称	ZZ500ETF
基金主代码	159968
交易代码	159968
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 8 月 1 日
报告期末基金份额总额	154,095,098.00 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	本基金主要采用完全复制法进行投资，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。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率。
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，属于中高风险中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，跟踪中证 500 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。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

## §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	
	(2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日)	
1.本期已实现收益	186,682,188.21	
2.本期利润	104,633,076.09	
3.加权平均基金份额本期利润	0.6226	
4.期末基金资产净值	996,231,051.07	
5.期末基金份额净值	6.4650	

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。

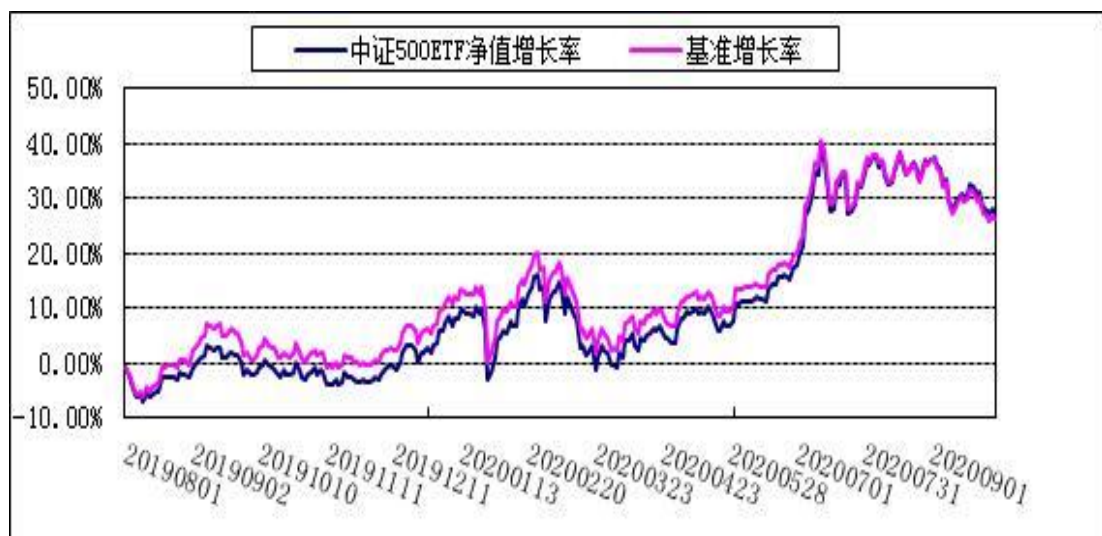
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

### 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	8.52%	1.68%	5.59%	1.68%	2.93%	0.00%
过去六个月	27.72%	1.44%	22.83%	1.45%	4.89%	-0.01%
过去一年	30.46%	1.56%	25.33%	1.58%	5.13%	-0.02%
自基金合同生 效起至今	27.44%	1.50%	26.30%	1.53%	1.14%	-0.03%

#### 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



注：本基金的基金合同于 2019 年 8 月 1 日生效。按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十五条“（二）投资范围”、“（四）投资组合管理”的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

## §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	2019-08-01	-	13.6	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联接基金(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(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)、博时中证可持续发展 100 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 1 月 19 日—至今)、博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 3 月 20 日—至今)、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 3 日—至今)、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 4 月 30 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，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

## 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 9 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

2020 年三季度，海外主要市场指数有所分化，其中，标普 500 上涨 8.47%，纳斯达克上涨 11.02%，日经 225 上涨 4.02%，英国富时 100 下跌 4.92%，法国 CAC40 下跌 2.69%，德国 DAX 指数上涨 3.65%，香港恒生指数下跌 3.96%。国内 A 股方面，基本处于上涨态势。汇率方面，人民币大幅升值，季度涨 3.72%。债券市场方面，受经济活动好转预期影响，10 年期国债收益率季度上行 33 个 BP，当前收益率为 3.15%。

行情方面，2020 年三季度主流指数全线上涨，偏大盘的上证 50 上涨 9.87%、沪深 300 指数上涨 10.17%，偏小盘的中证 500 上涨 5.58%，中证 1000 上涨 4.71%，科创概念指数创业板指在注册制的利好影响下上涨 5.60%。行业方面，中信一级行业中表现居前的是国防军工、消费者服务、电力设备及新能源、汽车、食品饮料，涨跌幅分别为 32.02%、26.56%、23.69%、20.42%、19.37%，跌幅较为靠前的行业是通信、商贸零售、综合金融、计算机、传媒，跌幅分别为 8.03%、3.05%、2.37%、2.06%、1.70%。

展望 2020 年四季度，宏观层面，全球整体增长预期边际有所改善，但疫情仍未见明显好转，负面影响仍在。中美关系方面出现一些积极信号，如央视恢复转播 NBA 等情况，但台海风险在进一步上升。国内经济方面，据文旅部统计，8 天长假期间全国共接待国内游客 6.37 亿人次，同比恢复 79.0%；国内旅游收入 4665.6 亿元，同比恢复 69.9%，经济持续改善可期。货币政策仍将保持适度宽松，但边际上开始逐步回归常

态，利率边际上升，未来估值的驱动力有限，盈利影响权重提升，市场结构性机会凸显。我们对 A 股中长期表现仍偏乐观。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 09 月 30 日，本基金基金份额净值为 6.4650 元，份额累计净值为 1.2744 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 8.52%，同期业绩基准增长率为 5.59%。

#### 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	912,493,511.91	90.55
	其中：股票	912,493,511.91	90.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	45,200.00	0.00
	其中：债券	45,200.00	0.00
	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	78,565,595.94	7.80
8	其他资产	16,591,559.84	1.65
9	合计	1,007,695,867.69	100.00

注：1、股票投资项包含可退替代款估值增值；

2、截至报告期末，股票投资中转融通融出股票金额 81,976,333.00 元，净值占比 8.23%。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,918,282.98	0.39

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	28,264.03	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	18,653.36	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,215.49	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,813.40	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	57,307.34	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	45,133.26	0.00
S	综合	-	-
	合计	4,140,698.98	0.42

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。

### 5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	7,936,217.00	0.80
B	采矿业	23,390,986.24	2.35
C	制造业	536,483,517.63	53.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,330,775.40	2.14
E	建筑业	12,140,933.00	1.22
F	批发和零售业	48,965,534.18	4.92
G	交通运输、仓储和邮政业	19,378,966.01	1.95
H	住宿和餐饮业	3,814,612.00	0.38
I	信息传输、软件和信息技术服务业	89,801,474.38	9.01
J	金融业	50,295,847.98	5.05
K	房地产业	32,280,364.71	3.24
L	租赁和商务服务业	16,398,902.02	1.65
M	科学研究和技术服务业	6,993,815.11	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	10,359,765.40	1.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,103,548.00	0.11
Q	卫生和社会工作	7,121,061.87	0.71
R	文化、体育和娱乐业	14,982,457.00	1.50
S	综合	5,575,454.00	0.56
	合计	908,354,231.93	91.18

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。

### 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股票投资明细

#### 5.3.1 期末指数投资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	002821	凯莱英	23,791	6,268,690.59	0.63
2	600739	辽宁成大	267,100	6,218,088.00	0.62
3	300253	卫宁健康	297,170	5,776,984.80	0.58
4	300012	华测检测	229,077	5,596,351.11	0.56
5	600079	人福医药	165,400	5,329,188.00	0.53
6	600298	安琪酵母	87,300	5,324,427.00	0.53
7	600201	生物股份	196,500	5,305,500.00	0.53
8	300207	欣旺达	192,200	5,206,698.00	0.52
9	002185	华天科技	379,100	5,193,670.00	0.52
10	002127	南极电商	296,777	5,122,371.02	0.51

#### 5.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	688185	康希诺	4,946.00	1,444,924.44	0.15
2	300999	金龙鱼	49,966.00	1,284,126.20	0.13
3	688596	正帆科技	12,927.00	249,878.91	0.03
4	688513	苑东生物	3,847.00	172,691.83	0.02
5	688595	芯海科技	3,190.00	154,842.60	0.02

### 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	45,200.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	45,200.00	0.00

### 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	128132	交建转债	452	45,200.00	0.00



## 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。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC2012	IC2012	65.00	78,005,200.00	4,841,100.47	-
公允价值变动总额合计(元)					4,841,100.47
股指期货投资本期收益(元)					6,327,354.72
股指期货投资本期公允价值变动(元)					244,864.64

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

## 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** 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。

### 5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	12,134,774.87
2	应收证券清算款	4,437,924.73
3	应收股利	-
4	应收利息	18,860.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,591,559.84

#### 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

##### 5.11.5.1 期末指数投资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	300012	华测检测	703,584.00	0.07	转融通融出
2	600298	安琪酵母	664,791.00	0.07	转融通融出
3	600739	辽宁成大	777,552.00	0.08	转融通融出
4	300253	卫宁健康	721,224.00	0.07	转融通融出
5	600201	生物股份	661,500.00	0.07	转融通融出
6	002127	南极电商	642,072.00	0.06	转融通融出
7	300207	欣旺达	644,742.00	0.06	转融通融出
8	600079	人福医药	654,066.00	0.07	转融通融出

##### 5.11.5.2 期末积极投资前五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	688185	康希诺	1,444,924.44	0.15	新股未上市
2	300999	金龙鱼	1,284,126.20	0.13	新股未上市
3	688596	正帆科技	249,878.91	0.03	新股未上市
4	688513	苑东生物	172,691.83	0.02	新股未上市
5	688595	芯海科技	154,842.60	0.02	新股未上市

#### 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

本报告期期初基金份额总额	181,295,098.00
报告期基金总申购份额	272,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	299,200,000.00
报告期基金拆分变动份额	0.00
本报告期期末基金份额总额	154,095,098.00

## §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
机构	1	2020-07-07~2020-07-12	32,118,808.00	-	29,579,785.00	2,539,023.00	1.65%
博时中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2020-07-01~2020-09-30	55,339,128.00	52,849,971.00	31,500,000.00	76,689,099.00	49.77%

### 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。

注：申购赎回金额包含场内二级市场交易金额。由于场内具体交易情况无法获悉，场内二级市场交易金额为本报告期间净买入/卖出金额。

## 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 2020 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理 233 只公募基金，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 12159 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 3655 亿元人民币，累计分红逾 1335 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。

2020 年 9 月 22 日，由《投资时报》及标点财经研究院联合主办的“见未来 2020 第三届资本市场高峰论坛暨金禧奖年度颁奖盛典”在京举办，凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金荣获三项大奖。博时获评“金禧奖 2020 卓越公募基金公司”、“金禧奖 2020 优秀固收类基金团队”、“金禧奖 2020 大湾区特别贡献奖”。

2020 年 9 月 15 日，《上海证券报》第十七届“金基金”奖颁奖典礼在上海隆重举行，凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金及子公司博时资本共荣获三项大奖。博时基金荣获 2019 年度金基金·海外投资回报基金管理公司奖。博时旗下基金产品博时新起点灵活配置混合型证券投资基金获得 2019 年度金基金·灵活配置型基金三年期奖。博时资本张存相荣获“金阳光 三年卓越私募基金经理（MOM 类）”奖项。

2020 年 8 月 6 日，《经济观察报》“见圳四十年---深圳经济特区成立 40 周年特别盛典”在深圳举办，博时基金荣获“致敬深圳经济特区成立四十周年卓越企业”奖项。

2020 年 7 月 9 日，新浪财经“2020 中国基金业开放与发展高峰论坛暨基金业致敬资本市场 30 周年峰会”在云端举办，届时公布了 2020 中国基金业金麒麟奖，博时基金荣获“2020 十大风云基金公司”，此外，博时基金王俊荣获“2020 最受青睐股票基金经理”奖项，博时基金赵云阳、桂征辉、王祥均荣获“2020 最受青睐指数与 ETF 基金经理”奖项。

2020 年 6 月 29 日，《证券时报》第十五届中国基金业明星基金奖榜单公布，博时基金共荣获三项大奖，旗下产品博时外延增长主题混合与博时宏观回报债券分别拿下“三年持续回报平衡混合型明星基金”与“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。博时信用债券基金摘得“十年持续回报债券型明星基金”奖。

2020 年 4 月 1 日，博时基金及子公司博时国际荣获《亚洲资产管理》2020“Best of the Best Awards”三项大奖。博时基金董事长兼总经理江向阳荣获“中国年度最佳 CEO”（Winner, China CEO of the Year-Jiang Xiangyang），博时基金（国际）有限公司荣获“香港最佳中资基金公司”（Winner, Hong Kong Best China Fund House），博时信用债基金荣获“中国在岸人民币债券最佳业绩（5 年）”（Winner, CNY Bonds, Onshore 5 Years-Bosera Credit Bond Fund）。

2020 年 3 月 31 日，《中国证券报》第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，博时基金旗下绩优产品博时信用债纯债债券荣获“七年期开放式债券型持续优胜金牛基金奖”。

2020 年 3 月 26 日，Morningstar 晨星（中国）2020 年度基金评选结果揭晓，博时信用债券在参选的同类 428 只基金中脱颖而出，摘得晨星“2020 年度激进债券型基金奖”。

2020 年 1 月 10 日，新京报“开放 普惠 科技”2019 金融行业评选颁奖典礼在北京举办，博时基金凭借在可持续发展金融方面的努力成果，荣获“2019 年度杰出社会责任影响力企业”。

2020 年 1 月 4 日，2020《财经》可持续发展高峰论坛暨长青奖典礼在北京举办，博时基金凭借在 ESG 投资及可持续发展金融推动方面的耕耘和成果，荣获“2020《财经》长青奖-可持续发展创新奖”。

## §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证 500 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 9.1.2 《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时中证 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 博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本
- 9.1.6 报告期内博时中证 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  
二〇二〇年十月二十八日