

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  
2021 年第 1 季度报告  
2021 年 3 月 31 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：二〇二一年四月二十二日

## §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 2021 年 4 月 20 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 2021 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 博时大湾区 ETF   |
| 场内简称       | 恒生湾区  |
| 基金主代码      | 159809  |
| 交易代码       | 159809  |
| 基金运作方式     | 交易型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2020 年 4 月 30 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 25,173,003.00 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       | <p>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。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，预期年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金日均跟踪偏离度和跟踪误差变大，基金管理人应采取合理措施，避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p> <p>本基金其他的投资策略包括债券（除可转换债券）投资策略、资产支持证券的投资策略、可转换债券投资策略、衍生品投资策略、融资、融券及转融通证券出借投资策略、流通受限证券投资策略和存托凭证投资策略等。</p> |
| 业绩比较基准     | 本基金的标的指数为恒生沪深港通大湾区综合指数。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即恒生沪深港通大湾区综合指数收益率。  |

|        |   |
|--------|---|
| 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，跟踪恒生沪深港通大湾区综合指数，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<br>(2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日) |
|----------------|---|
| 1.本期已实现收益      | 3,276,819.32                            |
| 2.本期利润         | 95,323.41                               |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0037                                  |
| 4.期末基金资产净值     | 31,699,454.87                           |
| 5.期末基金份额净值     | 1.2593                                  |

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。

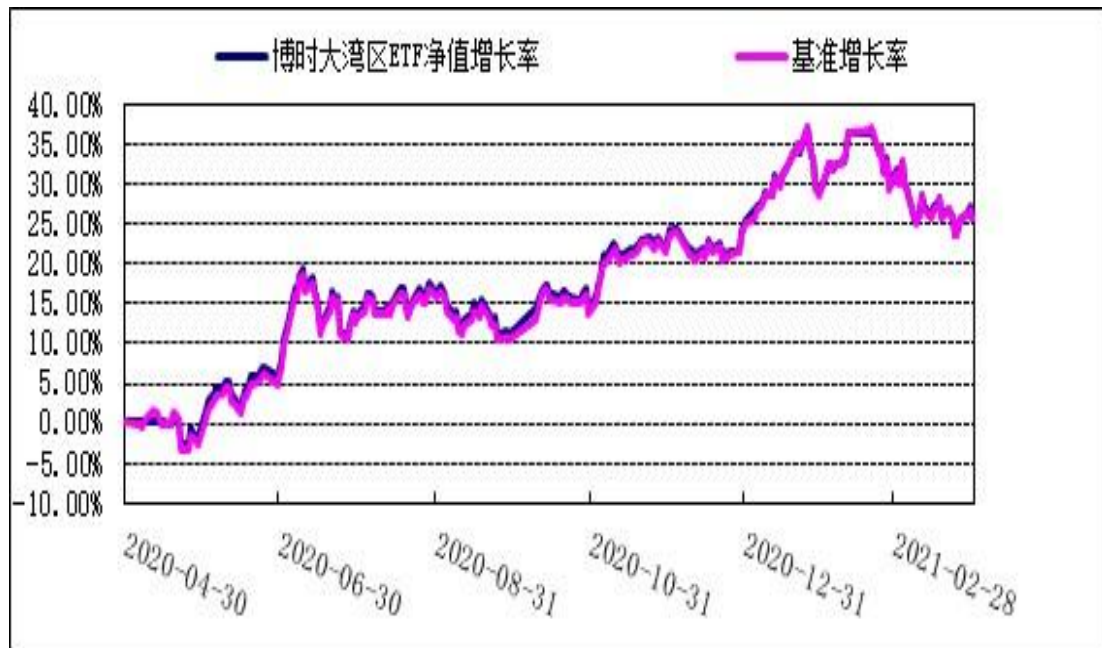
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 0.51%      | 1.28%         | 0.48%          | 1.30%                 | 0.03%  | -0.02% |
| 过去六个月          | 12.77%     | 1.11%         | 13.21%         | 1.11%                 | -0.44% | 0.00%  |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 25.93%     | 1.16%         | 25.63%         | 1.18%                 | 0.30%  | -0.02% |

### 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 2020 年 4 月 30 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 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十五部分“（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 | 2020-04-30  | -    | 14.0   | 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)、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)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 3 月 18 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 11 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

市场回顾：2021 年第一季度，美国债 10 年期收益率大幅上行 63 个 BP，月底收益率为 1.744%，导致全球金融市场大幅波动。汇率方面，人民币连续贬值趋势中止，全月微升 0.26%。行情方面，海外主要市场指数多数上涨，标普 500 上涨 5.77%，纳斯达克上涨 2.78%，日经 225 上涨 6.32%，英国富时 100 上涨 3.92%，法国 CAC40 上涨 9.29%，德国 DAX 指数上涨 9.40%，香港恒生指数上涨 4.21%。国内 A 股方面主要指数表现较弱，整体处于下跌趋势，其中沪深 300 指数下跌 3.13%，中证 500 下跌 1.78%，中证 1000 下跌 5.31%，而偏科技的指数的创业板指下跌 7.00%，科创 50 下跌 10.39%。恒生大湾区指数一季度上涨 0.48%。

展望 2021 年二季度，全球经济复苏预期，发达国家疫苗接种稳步推进中，预计今年 6-7 月英、美就可以实现 70% 的疫苗覆盖率，率先经济重启。疫苗普及加速与 1.9 万亿财政刺激落地推动美国 Q2、Q3 强势复苏，美国补库存行至中程，上半年继续为中国出口提供拉动力，出口上半年景气能够大致维持。国内经济表现整体维持高景气，环比动能逐渐触顶后温和回落，CPI 将到达阶段性高点，PPI 同比逐渐触顶。流动性上，美债利率依然易上难下，国内信用环境逐渐实质性收紧。经济政策延续中央经济工作会议基调，强调连续性，温和转向，促进经济运行在合理区间。关注碳达峰、科技创新和平台经济政策。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 03 月 31 日，本基金基金份额净值为 1.2593 元，份额累计净值为 1.2593 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 0.51%，同期业绩基准增长率为 0.48%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金曾于 2021 年 01 月 04 日至 2021 年 02 月 10 日及 2021 年 02 月 19 日至 2021 年 03 月 31 日出现连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

## §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   | 31,174,180.33 | 97.75        |
|    | 其中：股票  | 31,174,180.33 | 97.75        |
| 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      | 589,012.28    | 1.85   |
| 8 | 其他资产              | 129,389.18    | 0.41   |
| 9 | 合计                | 31,892,581.79 | 100.00 |

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 15,923,771.86 元，占基金总资产比例 49.93%。

## 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 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         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 37,224.00     | 0.12         |
| C  | 制造业              | 7,692,379.47  | 24.27        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 136,000.60    | 0.43         |
| E  | 建筑业              | 19,200.00     | 0.06         |
| F  | 批发和零售业           | 121,586.40    | 0.38         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 480,060.00    | 1.51         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 328,494.00    | 1.04         |
| J  | 金融业              | 4,720,530.00  | 14.89        |
| K  | 房地产业             | 1,263,316.00  | 3.99         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 35,138.00     | 0.11         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 184,585.00    | 0.58         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 65,956.00     | 0.21         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 88,935.00     | 0.28         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | 77,004.00     | 0.24         |
|    | 合计               | 15,250,408.47 | 48.11        |

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。

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|--------------|--------------|
| 电信业务     | 3,068,966.90 | 9.68         |
| 房地产      | 2,693,088.30 | 8.50         |
| 非日常生活消费品 | 1,477,471.00 | 4.66         |

|       |               |       |
|-------|---------------|-------|
| 工业    | 889,504.64    | 2.81  |
| 公用事业  | 562,851.85    | 1.78  |
| 金融    | 6,237,840.85  | 19.68 |
| 日常消费品 | 328,842.64    | 1.04  |
| 信息技术  | 430,407.91    | 1.36  |
| 医疗保健  | 98,258.94     | 0.31  |
| 原材料   | 136,538.83    | 0.43  |
| 合计    | 15,923,771.86 | 50.23 |

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

### 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  | 0700   | 腾讯控股  | 5,800  | 2,990,246.84 | 9.43         |
| 2  | 1299   | 友邦保险  | 32,600 | 2,598,235.45 | 8.20         |
| 3  | 601318 | 中国平安  | 22,400 | 1,762,880.00 | 5.56         |
| 4  | 0388   | 香港交易所 | 3,200  | 1,237,073.06 | 3.90         |
| 5  | 000001 | 平安银行  | 52,300 | 1,151,123.00 | 3.63         |
| 6  | 2318   | 中国平安  | 14,500 | 1,134,210.43 | 3.58         |
| 7  | 000333 | 美的集团  | 13,300 | 1,093,659.00 | 3.45         |
| 8  | 000651 | 格力电器  | 15,400 | 965,580.00   | 3.05         |
| 9  | 600036 | 招商银行  | 13,900 | 710,290.00   | 2.24         |
| 10 | 000002 | 万科 A  | 18,400 | 552,000.00   | 1.74         |

#### 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 5.4 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。

### 5.5 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。

### 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

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** 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除腾讯控股(0700)、平安银行(000001)、招商银行(600036)的发行主体外，没有出现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、处罚的情形。

主要违规事实：2021 年 3 月 12 日，因收购猿辅导（YUAN INC）股权涉嫌违法实施经营者集中案进行立案调查，该案构成未依法申报违法实施的经营者集中，但不具有排除、限制竞争的效果。国家市场监督管理总局对腾讯控股有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020 年 10 月 27 日，因存在 贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等违规行为，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对平安银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2021 年 2 月 10 日，因存在 1.备案类账户开户超过期限向人行账户系统中备案;2.未按规定履行客户身份识别义务;3.未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告等违规行为，中国人民银行沈阳分行对招商银行股份有限公司沈阳分行处以罚款的行政处罚。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

**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   | 8,206.57   |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | 8,007.02   |
| 4  | 应收利息    | 161.99     |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | 113,013.60 |

|   |    |            |
|---|----|------------|
| 8 | 其他 | -          |
| 9 | 合计 | 129,389.18 |

#### 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

##### 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

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。

##### 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 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

|              |               |
|--------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 28,173,003.00 |
| 报告期基金总申购份额   | 18,000,000.00 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 21,000,000.00 |
| 报告期基金拆分变动份额  | -             |
| 本报告期期末基金份额总额 | 25,173,003.00 |

## §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 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情 |
|---|----------------|-----------|

| 资<br>者<br>类<br>别  |        |                                |              |               |               | 况            |          |
|---|--------|--------------------------------|--------------|---------------|---------------|--------------|----------|
|   | 序<br>号 | 持有基金份额比例达到<br>或者超过20%的时间区<br>间 | 期初份额         | 申购份额          | 赎回份额          | 持有份额         | 份额占<br>比 |
| 机<br>构  | 1      | 2021-02-18~2021-02-21          | 2,356,499.00 | 22,725,345.00 | 22,528,320.00 | 2,553,524.00 | 10.14%   |
| 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。</p> <p>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。</p> |        |                                |              |               |               |              |          |

## 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 2021 年 3 月 31 日，博时基金公司共管理 259 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 14651 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 4208 亿元人民币，累计分红逾 1426 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。

其他大事件：

2021 年 03 月 27 日，在华夏时报主办的华夏机构投资者年会暨第十四届金蝉奖颁奖盛典中，博时基金荣获年度品牌基金公司奖。

2021 年 03 月 26 日，由广东时代传媒集团举办的“影响力中国时代峰会 2021”在广东广州举办，博时基金荣获《时代周报》第五届时代金融金桔奖“最佳财富管理机构奖”。

2021 年 03 月 18 日，由易趣财经传媒、《金融理财》杂志社主办的 2020 年度第十一届“金貔貅奖”颁奖晚宴暨中国金融创新与发展论坛在北京维景国际大酒店成功召开，博时基金获 2020 年度第十一届金貔貅奖

“年度金牌基金公司”。

2021 年 03 月 08 日，在《投资洞见与委托》(Insights & Mandate) 举办的 2021 年度专业投资大奖评选中，博时国际荣获五项年度大奖，包括“最佳机构法人投资经理”、“年度最佳 CEO”、“年度最佳 CIO（固定收益）”三项市场表现大奖，“亚洲年度最佳人民币投资公司”一项区域表现大奖，以及“中国离岸债券基金（3 年）”一项投资表现大奖。

## §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设立的文件。

9.1.2 《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》

9.1.3 《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各年度审计报告正本

9.1.6 报告期内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  
二〇二一年四月二十二日