博时中证500交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

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
登记机构:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2019年10月31日
公告日期:2019年10月28日

一、重要声明与提示

《博时中证500交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号(上市交易公告书的内容与格式)》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,博时中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)基金管理人博时基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。本基金托管人招商银行股份有限公司保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登于本基金管理人网站(www.bosera.com)上的《博时中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称:博时中证500交易型开放式指数证券投资基金
2、基金类型:股票型证券投资基金
3、运作方式:交易型开放式
4、基金存续期限:不定期
5、基金简称:博时中证500ETF
6、场内简称:ZZ500ETF
7、基金代码:159968
8、截至公告日前两个工作日的基金份额总额:截至2019年10月24日,本基金的基金份额总额为544,495,098份。
9、截至公告日前两个工作日的基金份额净值:截至2019年10月24日,本基金的基金份额净值为4.9599元。
10、本次上市交易的基金份额总额:截至2019年10月24日,本次上市交易的基金份额总额为544,495,098份。
11、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
12、上市交易日期:2019年10月31日
13、基金管理人:博时基金管理有限公司
14、基金托管人:招商银行股份有限公司
15、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司
16、申购赎回代办券商:
(1)场内申购、赎回代办证券公司
场内申购、赎回业务通过深圳证券交易所办理。
中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、招商证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、国信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、华鑫证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、方正证券股份有限公司。
(2)场外实物申购、赎回代办证券公司
场外实物申购、赎回业务通过中国证券登记结算有限责任公司办理。
中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、招商证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、国元证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、东兴证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、中万宏源证券有限公司、渤海证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、华福证券有限责任公司。

本基金网下股票发售代理机构:招商证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、国信证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、东兴证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、中万宏源证券有限公司、渤海证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、华福证券有限责任公司。

本基金网下股票发售代理机构:招商证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、东兴证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、中万宏源证券有限公司、东方证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、广州证券股份有限公司、华福证券有限责任公司。

(3)网上现金发售代理机构

网上现金发售通过具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位办理:

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、西信证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、中万宏源西部证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华西证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华鑫证券、华融证券、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联储证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、中泰证券、国融证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、九州证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏东方财富证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信证券、中信山东、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券(排名不分先后)。

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的深交所会员可通过深交所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。

8、募集资金总额及入账情况:本基金自2019年7月1日起向社会公开募集,截至2019年7月26日募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验资,此次募集的有效净认购金额为人民币72,762,083,202.00元,认购资金在募集期间产生的利息为人民币102,659.00元。本次现金认购资金于2019年8月1日划入本基金托管账户,网下认购股票于2019年8月1日划至本基金证券账户,网下现金认购资金在募集期间产生的利息于2019年8月1日划入本基金托管账户,网上现金认购资金在募集期间产生的利息至银行下一结息日的下一自然日已全部划入本基金托管账户。

本次募集有效认购户数为25,058户,按照每份基金份额面值1.00元人民币计算,本次募集实际募集到的有效认购份额为544,495,098份,已全部计入各基金份额持有人的基金账户。

9、基金备案情况:本基金于2019年8月1日得到中国证监会书面确认,基金备案手续办理完毕。根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《博时中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的募集情况已符合基金合同生效的条件,基金合同于2019年8月1日正式生效。

10、基金合同生效日:2019年8月1日。

11、基金合同生效日份额总额:2,762,185,861.00份。

12、基金份额折算

根据《博时中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《博时中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,博时基金管理有限公司决定对本基金进行基金份额折算与变更登记,并确定2019年10月18日为基金份额折算日。本次基金份额折算前基金份额总额为2,762,185,861.00份,折算前基金份额净值为0.9781元。根据本次基金份额折算前基金份额折算的公告约定的基金份额折算公式,本次基金份额折算比例为0.197128864,折算后,2019年10月21日基金份额总额为544,495,098份,折算后基金份额净值为4.9618元。本基金管理人已根据上述折算比例,对各基金份额持有人持有的基金份额进行了折算,本基金登记结算机构已于2019年10月21日进行了变更登记。

(二)基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上[2019]664号
2、上市交易日期:2019年10月31日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
4、基金二级市场交易简称:ZZ500ETF
5、基金二级市场交易代码:159968
6、本次交易上市份额:544,495,098份(截至2019年10月24日)
7、未上市交易份额的流通规定:本基金上市交易后,所有的基金份额均可进行交易,不存在未上市交易的基金份额。

8、基金资产净值的披露:在本基金上市交易并开始办理基金份额申购赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值,并在深圳证券交易所行情发布系统揭示基金份额净值。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数

截至公告日前两个工作日即2019年10月24日,本基金份额持有人户数为24,894户,平均每户持有的基金份额为218772.54份。

(二)持有人结构

截至公告日前两个工作日即2019年10月24日,本基金份额持有人结构如下:

机构投资者持有的基金份额为194,786,813.00份,占基金总份额的35.77%;个人投资者持有的基金份额为349,708,285.00份,占基金总份额的64.23%。

(三)前十名基金份额持有人的情况:

截至公告日前两个工作日即2019年10月24日,前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称(全称)	持有基金份额(份)	占场内总份额比例(%)
1	中国建银投资有限责任公司	72,552,009.00	13.32
2	中信中证资本管理有限公司	21,651,424.00	3.98
3	中国国际金融股份有限公司	21,601,557.00	3.97
4	中信证券股份有限公司	19,638,472.00	3.61
5	华泰证券股份有限公司	9,980,535.00	1.83
6	中信建投证券股份有限公司	9,843,748.00	1.81
7	江苏鱼跃医疗设备股份有限公司-第一期员工持股计划	9,178,221.00	1.69
8	宁波拢琪投资管理合伙企业(有限合伙)	8,872,782.00	1.63
9	张家港保税区丰宝成贸易有限公司	8,377,878.00	1.54
10	孙雪理	5,116,676.00	0.94
11	谭庆	5,116,676.00	0.94
12	吴海宏	5,116,676.00	0.94
13	赵玉岭	5,116,676.00	0.94
14	郑建军	5,116,676.00	0.94

注:以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1、基金管理人概况

名称:博时基金管理有限公司
法定代表人:张光华
总经理:江向阳
成立时间:1998年7月13日
注册资本:25亿元人民币
注册地址:深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层
设立批准文号:中国证监会证监基字[1998]26号
工商登记注册的法人营业执照文号:440301103465194号
经营范围:基金募集;基金销售;资产管理以及中国证监会许可的其它业务(涉及行政许可的凭许可证经营)
2、股权结构

目前博时基金管理有限公司股东为招商证券股份有限公司,持有股份49%;中国长城资产管理公司,持有股份25%;天津港(集团)有限公司,持有股份6%;上海汇华实业有限公司,持有股份12%;上海蕴业股权投资基金有限公司,持有股份6%;广厦建设集团有限责任公司,持有股份2%。注册资本为25亿元人民币。

3、内部组织结构及职能:

公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设两大总部和二十八个直属部门,分别是:权益投资总部、固定收益总部以及宏观策略部、交易部、指数与量化投资部、多元资产管理部、年金投资部、绝对收益投资部、产品规划部、销售管理部、客户服务中心、市场部、养老金业务中心、战略客户部、机构-上海、机构-南方、券商业务部、零售-北京、零售-上海、零售-南方、央企业务部、互联网金融部、董事会办公室、办公室、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、风险管理部和监察法律部。

权益投资总部负责公司所管理资产的权益投资管理及相关工作。权益投资总部下设股票投资部(含各投资风格小组),特定资产管理部、研究部。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。特定资产管理部负责公司所管理资产的权益投资管理及相关工作。权益投资总部下设股票投资及相关工作、研究部负责完成对宏观经济、投资策略、行业上市公司及市场的研究。固定收益总部负责公司所管理资产的固定收益投资管理及相关工作。固定收益总部下设现金管理组、公募基金组、专户组、指数与创新组、国际组和研究组,分别负责各类固定收益资产的研究和投资工作。

市场部负责市场竞争分析、市场政策拟订;组织落实公司总体市场战略,协同产品和投资体系以及市场团队的协同;拟订年度市场计划和费用预算,具体负责机构业务的绩效考核和费用管理;公司品牌及产品传播;机构产品营销组织、市场分析等工作。战略客户部负责北方地区由国资委和财政部直接管辖企业以及该区域机构客户的销售与服务工作。机构-上海和机构-南方分别主要负责华东地区、华南地区以及其他指定区域的机构客户销售与服务工作。养老金业务中心负责公司社保基金、企业年金、基本养老金及职业年金的客户拓展、销售与服务、养老金研究与政策咨询、养老金销售支持与中台运作协调,相关信息服务等工作。券商业务部负责券商渠道的开拓和销售服务。零售-北京、零售-上海、零售-南方负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。央企业务部负责招商局集团签约机构客户,重要中央企业及其财务公司等客户的拓展、合作业务落地与服务等工作。销售管理部负责总行渠道维护,零售产品营销组织、销售督导;营销策划及公募销售支持;营销培训管理;渠道代销支持与服务;零售体系的绩效考核与费用管理等工作。

宏观策略部负责为投委会审定资产配置计划提供宏观研究和策略研究支持。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。指数与量化投资部负责公司各类指数与量化投资产品的研究和投资管理工作。多元资产管理部负责公司的基金中基金投资产品的研究和投资管理工作。年金投资部负责公司所管理企业年金等养老金资产的投资管理及相关工作。绝对收益投资部负责公司绝对收益产品的研究和投资管理工作。产品规划部负责新产品设计、新产品报批、主管部门沟通维护、产品维护以及和年金方案设计等工作。互联网金融部负责公司互联网金融战略规划的设计和实施,公司互联网金融的平台建设、业务拓展和客户运营,推动公司相关业务在互联网平台的整合与创新。客户服务中心负责电话与网络咨询与服务;呼出业务与电话营销理财;营销系统数据维护与挖掘;直销柜台业务;专户合同及备案管理、机构售前支持;专户中台服务与运营支持等工作。

董事会办公室专门负责股东会、董事会、监事会及董事会各专业委员会各项会务工作;股东关系管理与董、监事的联络、沟通及服务;基金行业政策、公司治理、战略发展研究、公司文化建设;与公司治理及发展战略等相关的重大信息披露管理;政府公共关系管理;党务工作;博时慈善基金会的管理及运营等。办公室负责公司的行政后勤支持、会议及文件管理、外事活动管理、档案管理及工会工作等。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、员工沟通、人力资源信息管理工作。财务部负责公司预算管理、财务核算、成本控制、财务分析等工作。信息技术部负责信息系统开发、网络运行及维护、IT系统安全及数据备份等工作。基金运作部负责基金会计和基金注册登记等业务。风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程,组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作,确保公司各类投资风险得到及时监督与控制。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察,并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。

另设北京分公司和上海分公司,分别负责对驻京、沪人员日常行政管理和对赴京、沪、处理公务人员给予协助。此外,还设有全资子公司博时资本管理有限公司,以及境外子公司博时基金(国际)有限公司。

4、人员情况:

截止到2019年6月30日,公司总人数为570人,其中研究员和基金经理超过89%拥有硕士及以上学位。

5、信息披露负责人:孙麒清
电话:0755-83169999
6、基金管理业务情况简介:

截至2019年6月30日,博时基金公司共管理185只开放式基金,管理资产总规模逾9345亿元人民币,其中公募基金资产规模逾5665亿元人民币。

7、本基金基金经理

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,历任投资助理,基金经理助理、博时富时中国A股指数基金(2017.9.29-2019.9.5)的基金经理。现任博时上证超大盘ETF基金(2015.6.8-至今)、博时上证超大盘ETF联接基金(2015.6.8-至今)、博时上证自然资源ETF基金(2015.6.8-至今)、博时上证自然资源ETF联接基金(2015.6.8-至今)、博时标普500ETF基金(2015.10.8-至今)、博时标普500ETF联接(QDII)基金(2015.10.8-至今)、博时中证500ETF基金(2019.8.1-至今)的基金经理。

(二)基金托管人情况

1、基本情况

名称:招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)
设立日期:1987年4月8日
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
注册资本:252.20亿元
法定代表人:李建红
行长:田惠宇
资产托管业务批准文号:证监基金字[2002]83号
电话:0755-83199084
传真:0755-83195201
资产托管部信息披露负责人:张燕
2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年3月成功地发行了15亿A股,4月9日在上交所挂牌(股票代码:600036),是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股,9月22日在香港联交所挂牌交易(股票代码:3968),10月5日行使H股超额配售,共发行了24.2亿H股。截至2019年6月30日,本集团总资产71,931.81亿元人民币,高级法下资本充足率15.09%,权重法下资本充足率12.60%。

2002年8月,招商银行成立基金托管部;2005年8月,经报中国证监会同意,更名为资产托管部,现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金团队、系统与数据团队7个职能团队,现有员工83人。2002年11月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格,成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003年4月,正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行,拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管(QFII)、合格境内机构投资者托管(QDII)、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值,独创“6S托管银行”品牌体系,以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品:在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,推出国内首个托管大数据平台,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只POP、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管,实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变,得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展,社会影响力不断提升,四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”,成为国内唯一获得该奖项的托管银行;“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”;7月荣膺2016年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017年6月招商银行再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”;“全功能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017中国金融创新“十佳金融产品创新奖”;8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018年1月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017年度优秀资产托管机构”奖项;同月,招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖,以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖;3月荣膺公募基金20年“最佳基金托管银行”奖;5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”;12月荣膺2018东方财富风云榜“2018年度最佳托管银行”、“20年最值得信赖托管银行”奖。2019年3月招商银行荣获《中国基金报》“2018年度最佳基金托管银行”奖;6月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖。

3、主要人员情况

李建红先生,本行董事长、非执行董事,2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士,高级经济师。招商局集团有限公司董事长,兼任招商局国际有限公司董事会主席,招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长、曾任中国远洋运输(集团)总公司总裁助理、总经济师、副总裁,招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生,本行行长、执行董事,2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位,高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

汪建中先生,本行副行长。1991年加入本行;2002年10月至2013年12月历任本行长沙分行行长,总行公司银行部副总经理,佛山分行筹备组组长,佛山分行行长,武汉分行行长;2013年12月至2016年10月任本行业务总监兼公司金融总部总裁,期间先后兼任公司金融综合管理部总经理、战略客户部总经理;2016年10月至2017年4月任本行业务总监兼北京分行行长;2017年4月起任本行党委委员兼北京分行行长。2019年4月起任本行副行长。

姜然女士,招商银行资产托管部总经理,大学本科毕业,具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行,华商银行,中国农业银行深圳市分行,从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今,历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一,具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

4、基金托管业务经营情况

截至2019年6月30日,招商银行股份有限公司累计托管479只证券投资基金。

(三)基金验资机构

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:沈兆杰
经办注册会计师:张振波、沈兆杰

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件:基金合同摘要。

七、基金财务状况

(一)基金募集期间费用

基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中列支。

(二)基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三)基金资产负债表

截至公告前两个工作日即2019年10月24日,本基金的资产负债表如下(未经审计):

单位:人民币元

资产	本报告期末 2019年10月24日
资产:	
银行存款	327,348,576.26
结算备付金	34,626,820.37
存出保证金	13,143,412.10
交易性金融资产	2,460,460,623.99
其中:股票投资	2,460,460,623.99
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	261,937.87
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	2,835,841,370.59
负债和所有者权益	
负 债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	132,326,490.28
应付赎回款	-
应付管理人报酬	268,088.52
应付托管费	89,362.84
应付销售服务费	-
应付交易费用	2,268,566.79
应交税费	434.60
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	243,449.59
负债合计	135,196,392.62
所有者权益:	
实收基金	2,762,185,861.00
未分配利润	-61,540,883.03
所有者权益合计	2,700,644,977.97
负债和所有者权益总计	2,835,841,370.59

注:截至2019年10月24日,基金份额净值4.9599元,基金份额总额544,495,098份。

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即2019年10月24日,本基金的投资组合情况如下:

(一)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	2,460,460,623.99	86.76%
	其中:股票	2,460,460,623.99	86.76%
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	361,975,396.63	12.76%
6	其他资产	13,405,349.97	0.47%
7	合计	2,835,841,370.59	100.00%

(二)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	25,841,448.00	0.96%
B	采矿业	76,716,578.92	2.84%
C	制造业	1,397,452,888.27	51.75%
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	77,070,379.00	2.85%
E	建筑业	39,598,134.65	1.47%
F	批发和零售业	124,230,345.35	4.60%
G	交通运输、仓储和邮政业	79,386,655.20	2.94%
H	住宿和餐饮业	8,545,488.00	0.32%
I	信息传输、软件和信息技术服务业	248,592,062.10	9.20%
J	金融业	112,189,068.36	4.15%
K	房地产业	112,602,794.16	4.17%
L	租赁和商务服务业	34,380,153.72	1.27%
M	科学研究和技术服务业	3,556,719.00	0.13%
N	水利、环境和公共设施管理业	20,223,570.88	0.75%
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	11,431,893.00	0.42%
Q	卫生和社会工作	18,432,168.00	0.68%
R	文化、体育和娱乐业	48,602,067.58	1.80%
S	综合	21,608,209.80	0.80%
	合计	2,460,460,623.99	91.11%

(三)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	002463	沪电股份	769,700	18,526,679.00	0.08%
2	600183	生益科技	725,400	17,852,094.00	0.69%
3	600745	闻泰科技	243,700	16,905,469.00	0.66%
4	000066	中国长城	1,122,900	16,158,531.00	0.63%
5	000860	顺鑫农业	330,900	15,310,743.00	0.60%
6	600872	中炬高新	355,400	14,621,156.00	0.57%
7	002405	四维图新	1,000,600	14,168,496.00	0.54%
8	600201	生物股份	739,100	14,124,201.00	0.52%
9	002049	紫光国微	270,700	13,562,070.00	0.52%
10	600536	中国软件	189,100	13,530,105.00	0.50%

(四)按券种分类的债券投资组合

截至2019年10月24日,本基金未持有债券。

(五)按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

截至2019年10月24日,本基金未持有债券。

(六)按公允价值占净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

截至2019年10月24日,本基金未持有资产支持证券。

(七)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

截至2019年10月24日,本基金未持有贵金属。

(八)按公允价值占净值比例大小排序的前五名权证投资明细

截至2019年10月24日,本基金未持有权证。

(九)本基金投资股指期货交易情况说明

1、股指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
IC1912	IC1912	92.00	89,663,200.00	-1,669,200.00	-
公允价值变动总额合计(元)				-1,669,200.00	
股指期货投资本期收益(元)				-	
股指期货投资本期公允价值变动(元)				-1,669,200.00	

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。

(十)本基金投资的国债期货交易情况说明

截至2019年10月24日,本基金未持有国债期货。

(十一)投资组合报告附注

1、本报告期内,本基金投资的前十名证券中除间泰科技(600745)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。

2019年8月16日,因公司高管在重大资产重组决策程序、停复牌事项办理和信息披露职责履行方面存在违规行为,上海证券交易所对闻泰科技股份有限公司处以公开批评的行政处罚。

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。

2、本基金前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成如下:

序号	其他资产	金额(元)
1	存出保证金	13,143,412.10
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	其他资产	261,937.87
5	合计	13,405,349.97

4、本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至2019年10月24日,本基金未持有可转换债券。

5、本报告期前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至2019年10月24日,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

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。

九、重大事件揭示

(一)2019年8月2日发布《博时中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告》。

(二)2019年10月15日发布《关于博时中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》。

(三)2019年10月18日发布《关于博时中证500交易型开放式指数证券投资基金修订交易结算模式及申购赎回规则并相应修改基金合同和招募说明书的公告》。

(四)2019年10月22日发布《博时基金管理有限公司关于博时中证500交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告》。

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

(二)根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查;如发现基金管理人违反《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,将及时通知基金管理人纠正;基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、备查文件目录

(一)中国证监会准予博时中证500交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件
(二)《博时中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
(三)《博时中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
(四)《博时中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
(五)基金管理人业务资格批件、营业执照
(六)基金托管人业务资格批件、营业执照
(七)法律意见书
(八)中国证监会要求的其他文件

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。

风险提示:本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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险,敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件,并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

博时基金管理有限公司
2019年10月28日

附件:基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

(一)基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额,即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:

(1)分享基金财产收益;
(2)参与分配清算后的剩余基金财产;
(3)依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;
(4)按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会;
(5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使