

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
2020 年中期报告
2020 年 6 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：二〇二〇年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 期末投资目标基金明细	39
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.7 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	42
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42
7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	43
7.10 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	43
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.13 投资组合报告附注	43
§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	44
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	45
§9 开放式基金份额变动	45
§10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8 其他重大事件	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息	48
11.1 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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	
基金简称	博时中证 500ETF 联接	
基金主代码	008396	
交易代码	008396	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 12 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	
报告期末基金份额总额	325,761,331.00 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时中证 500ETF 联接 A	博时中证 500ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	008396	008397
报告期末下属分级基金的份额总额	157,498,220.36 份	168,263,110.64 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	博时中证 500ETF
基金主代码	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
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019 年 10 月 31 日
基金管理人名称	博时基金管理有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数即中证 500 指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。投资策略包括资产配置策略、基金投资策略、成份股、备选成份股投资策略、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、融资及转融通证券出借、股指期货、股票期权及其他金融衍生品的投资策略。为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35%，预期年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其

	他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。同时，本基金为被动式投资的股票指数基金，跟踪中证 500 指数，其预期风险与预期收益高于债券型基金、混合型基金、货币市场基金，属于中高风险与中高收益的开放式基金。

2.2.1 目标基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒麟	张燕
	联系电话	0755-83169999	0755-83199084
	电子邮箱	service@bosera.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	95555
传真		0755-83195140	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518040	518040
法定代表人		江向阳	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层
--------	------------	--------------------------------

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）	
	博时中证 500ETF 联接 A	博时中证 500ETF 联接 C
本期已实现收益	12,263,230.06	11,950,509.08
本期利润	25,038,018.66	24,606,780.71
加权平均基金份额本期利润	0.1892	0.2683
本期加权平均净值利润率	18.60%	25.99%
本期基金份额净值增长率	10.03%	9.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	博时中证 500ETF 联接 A	博时中证 500ETF 联接 C
期末可供分配利润	13,655,614.09	14,320,542.09
期末可供分配基金份额利润	0.0867	0.0851
期末基金资产净值	173,305,717.59	184,876,838.95
期末基金份额净值	1.1004	1.0987
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	博时中证 500ETF 联接 A	博时中证 500ETF 联接 C
基金份额累计净值增长率	10.04%	9.87%

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。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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 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

博时中证 500ETF 联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	8.57%	0.86%	8.04%	0.84%	0.53%	0.02%
过去三个月	17.21%	1.06%	15.47%	1.08%	1.74%	-0.02%
过去六个月	10.03%	1.60%	10.84%	1.70%	-0.81%	-0.10%
自基金合同生效起至今	10.04%	1.59%	12.64%	1.69%	-2.60%	-0.10%

博时中证 500ETF 联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	8.54%	0.86%	8.04%	0.84%	0.50%	0.02%
过去三个月	17.12%	1.06%	15.47%	1.08%	1.65%	-0.02%
过去六个月	9.86%	1.60%	10.84%	1.70%	-0.98%	-0.10%
自基金合同生效起至今	9.87%	1.59%	12.64%	1.69%	-2.77%	-0.10%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

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

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019 年 12 月 30 日至 2020 年 6 月 30 日)

博时中证 500ETF 联接 A



博时中证 500ETF 联接 C



注：本基金的基金合同于 2019 年 12 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六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条“（二）投资范围”、“（四）投资限制”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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 6 月 30 日，博时基金公司共管理 224 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 12150 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 3882 亿元人民币，累计分红逾 1296 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 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”。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
万琼	基金经理	2019-12-30	-	13.3	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 日一至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (2015 年 10 月 8 日一至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 (2019 年 8 月 1 日一至今)、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 日一至今)、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 日一至今)、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 日一至今)、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 3 日一至今)、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 日一至今)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，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 93 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年，受新冠疫情冲击，全球资本市场跌宕起伏，波动较大，多数发达市场收跌。国际方面，美国标普 500 下跌 4.04%，而科技指数纳斯达克指数上涨 12.11%，日经 225 指数下跌 5.78%，欧洲股市中英国富时 100 下跌 18.20%，德国 DAX 指数下跌 7.08%，法国 CAC40 下跌 17.43%。香港恒生指数下跌 13.35%。国内 A 股方面，在率先走出新冠疫情后复产复工稳步推进及宽松预期下，市场整体表现尚可。结构上，在复产复工与疫情反复共同交织叠加宽松预期背景下，科技、医药、消费板块共同发力。债券市场方面，同样受疫情和应对经济活动疲软影响，债券收益率震荡下行，10 年期国债收益率从 3.14 下行至 2.82。

行情方面，2020 年上半年，市场整体处于上涨行情，在主流宽基指数中，仅偏大盘的上证 50 下跌，跌幅为 3.95%，而沪深 300 上涨 1.64%，偏中小盘的中证 500 上涨 11.33%，中证 1000 上涨 13.52%，科技、医药集中的创业板指表现最好，上涨 35.60%。风格指数方面，中盘成长表现最好，上涨 18.00%，大盘价值表现最弱，下跌 12.62%。行业方面，中信一级行业中，医药、消费者服务、食品饮料、电子、计算机表现最为抢眼，分别上涨 41.56%、26.32%、25.41%、24.22%、22.92%。而石油石化、煤炭、银行、非银金融、房地产下跌，跌幅分别是 17.47%、15.53%、13.02%、10.67%、8.54%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1004 元，份额累计净值为 1.1004 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0987 元，份额累计净值为 1.0987 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 10.03%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 9.86%，同期业绩基准增长率 10.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年下半年，海外疫情蔓延出使经济衰退风险持续上升，预计未来美联储将继续保持流动性充盈，在此背景下或推动外资持续流入 A 股。国内方面，宽松财政政策开始发力，二季度流动性边际有所收紧，但受失业率上行压力，预计央行仍将保持流动性宽松。A 股市场风格整体分化

尽管有所弥合，高低估值板块差异仍较大，现阶段估值与基本面存在一定背离。

我们对 A 股长期表现偏乐观，但需注意仓位的灵活性，把握结构性机会。投资风格上，围绕内循环等内需主题机会，继续重点配置行业龙头公司，长期配置消费、医药、科技的基础性配置，但需注意高低估值板块估值收敛。结构上把握两条主线，一条主线是关注受益于疫情后的内需恢复的可选消费板块（包括消费者服务、汽车等）和自主可控的科技、医药板块（包括消费电子、云计算、智能家居、医疗设备等）。另一条主线是逐步复苏后存在业绩预期差的周期板块（包括建筑建材、机械、化工等）以及后周期低估值板块（包括银行、非银金融等）。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金曾于 2020 年 01 月 02 日至 2020 年 02 月 13 日出现连续 20 个工作日资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		—	—
银行存款	6.4.7.1	230,600,442.51	37,913,011.63
结算备付金		5,275,173.35	—
存出保证金		1,307,770.34	—
交易性金融资产	6.4.7.2	332,060,472.06	—
其中：股票投资		376,617.00	—
基金投资		329,682,855.06	—
债券投资		2,001,000.00	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,859,204.00	-
应收利息	6.4.7.5	29,598.10	3,791.30
应收股利		-	-
应收申购款		13,898,965.17	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		587,031,625.53	37,916,802.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,937,216.10	-
应付赎回款		222,258,805.27	-
应付管理人报酬		3,738.11	155.82
应付托管费		1,246.03	51.94
应付销售服务费		79,358.18	157.83
应付交易费用	6.4.7.7	41,092.62	-
应交税费		448,113.23	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	79,499.45	-
负债合计		228,849,068.99	365.59
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	325,761,331.00	37,913,011.63
未分配利润	6.4.7.10	32,421,225.54	3,425.71
所有者权益合计		358,182,556.54	37,916,437.34
负债和所有者权益总计		587,031,625.53	37,916,802.93

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 325,761,331.00 份。其中 A 类基金份额净值 1.1004 元，基金份额总额 157,498,220.36 份；C 类基金份额净值 1.0987 元，基金份额总额 168,263,110.64 份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
----	-----	----

		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		50,169,755.06
1. 利息收入		81,148.97
其中：存款利息收入	6.4.7.11	78,806.50
债券利息收入		2,342.47
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,614,981.89
其中：股票投资收益	6.4.7.12	502,053.90
基金投资收益	6.4.7.13	18,329,159.48
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.15	1,783,689.31
股利收益	6.4.7.16	79.20
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	25,431,060.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,042,563.97
减：二、费用		524,955.69
1. 管理人报酬		15,127.18
2. 托管费		5,042.27
3. 销售服务费		142,445.99
4. 交易费用	6.4.7.19	264,270.71
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		50,481.26
7. 其他费用	6.4.7.20	47,588.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		49,644,799.37
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		49,644,799.37

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	37,913,011.63	3,425.71	37,916,437.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	49,644,799.37	49,644,799.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	287,848,319.37	-17,226,999.54	270,621,319.83
其中：1. 基金申购款	1,037,658,522.29	17,751,420.23	1,055,409,942.52
2. 基金赎回款	-749,810,202.92	-34,978,419.77	-784,788,622.69
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	325,761,331.00	32,421,225.54	358,182,556.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：王德英，会计机构负责人：成江

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2160 号《关于准予博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复》核准，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 37,912,242.20 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0801 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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基金合同》于 2019 年 12 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 37,913,011.63 份基金份额，其中认购资金利息折合 769.43 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金根据认购、申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投

投资者认购、申购时收取认购、申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

本基金为博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（简“目标 ETF”）的联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》的有关规定，本基金通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数即中证 500 指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化；本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股票、国内依法发行上市的标的指数非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、地方政府债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、货币市场工具（银行存款、同业存单、债券回购）、股指期货、股票期权、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%，股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持对现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款税后利率 $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2019 年 12 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外, 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时, 按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产, 取得时发生的相关交易费用计入当期损益; 对

于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金

融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	230,600,442.51
定期存款	—
其他存款	—
合计	230,600,442.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	344,761.00	376,617.00	31,856.00
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	2,003,200.00	2,001,000.00
	银行间市场	—	—
	合计	2,003,200.00	2,001,000.00
资产支持证券	—	—	—
基金	304,373,130.83	329,682,855.06	25,309,724.23
其他	—	—	—
合计	306,721,091.83	332,060,472.06	25,339,380.23

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	8,702,880.00	—	—	—
股指期货	8,702,880.00	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—
合计	8,702,880.00	—	—	—

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，

结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2012	中证 500 期货 2012 合约	8	8,794,560.00	91,680.00
减：可抵销期货暂收款				91,680.00
股指期货投资净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	5,017.85
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,141.88
应收债券利息	21,328.77
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	109.60
合计	29,598.10

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	41,092.62
银行间市场应付交易费用	-
合计	41,092.62

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	34,745.65
应付证券出借违约金	-
其他应付款	-
预提费用	44,753.80
合计	79,499.45

6.4.7.9 实收基金

博时中证 500ETF 联接 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	18,711,371.13	18,711,371.13
本期申购	628,550,934.29	628,550,934.29
本期赎回（以“-”号填列）	-489,764,085.06	-489,764,085.06
本期末	157,498,220.36	157,498,220.36

博时中证 500ETF 联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	19,201,640.50	19,201,640.50
本期申购	409,107,588.00	409,107,588.00
本期赎回（以“-”号填列）	-260,046,117.86	-260,046,117.86
本期末	168,263,110.64	168,263,110.64

注：1. 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2019 年 12 月 12 日至 2019 年 12 月 25 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 37,912,242.20 元，折合为 37,912,242.20 份基金份额（其中 A 类基金份额 18,710,984.91 份，C 类基金份额 19,201,257.29 份）。根据《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招募说明书》的规定，本基金设立募集期间内认购资金产生的利息收入人民币 769.43 元在本基金成立后，折合为 769.43 份基金份额（其中 A 类基金份额 386.22 份，C 类基金份额 383.21 份），划入基金份额持有人账户。

3. 根据《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基金合同》、《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招募说明书》以及《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开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于 2019 年 12 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 1 月 14 日止期间暂不向投资人开放，基金交易申购业务、赎回业务、转换业务和定期定额投资业务自 2020 年 1 月 15 日起开始办理。

6.4.7.10 未分配利润

博时中证 500ETF 联接 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,768.60	-	1,768.60
本期利润	12,263,230.06	12,774,788.60	25,038,018.66
本期基金份额交易产生的变动数	1,390,615.43	-10,622,905.46	-9,232,290.03
其中：基金申购款	17,093,660.18	-9,083,509.35	8,010,150.83
基金赎回款	-15,703,044.75	-1,539,396.11	-17,242,440.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,655,614.09	2,151,883.14	15,807,497.23

博时中证 500ETF 联接 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,657.11	-	1,657.11
本期利润	11,950,509.08	12,656,271.63	24,606,780.71
本期基金份额交易产生的变动数	2,368,375.90	-10,363,085.41	-7,994,709.51
其中：基金申购款	12,741,969.96	-3,000,700.56	9,741,269.40
基金赎回款	-10,373,594.06	-7,362,384.85	-17,735,978.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,320,542.09	2,293,186.22	16,613,728.31

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	52,794.22
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	25,337.09
其他	675.19
合计	78,806.50

6.4.7.12 股票投资收益
6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	188,282.88
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	313,771.02
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	502,053.90

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	73,749,880.65
减：卖出股票成本总额	73,561,597.77
买卖股票差价收入	188,282.88

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	136,571,600.00
减：现金支付申购款总额	63,224,764.95
减：申购股票成本总额	73,033,064.03
申购差价收入	313,771.02

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	395,993,150.86
减：卖出/赎回基金成本总额	377,663,991.38
基金投资收益	18,329,159.48

6.4.7.14 债券投资收益

无发生额。

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	1,783,689.31

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	79.20
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	79.20

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	25,339,380.23
——股票投资	31,856.00
——债券投资	-2,200.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	25,309,724.23
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	91,680.00
——权证投资	-
——股指期货	91,680.00
4. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	25,431,060.23

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,030,275.88
基金转换费收入	12,288.09
合计	4,042,563.97

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	220,067.36
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	44,203.35
其中：申购费	-
赎回费	-
基金交易费用	44,203.35
合计	264,270.71

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

审计费用	19,890.78
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,434.48
开户费	400.00
合计	47,588.28

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	116,048,143.98	70.94%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例
招商证券	838,419,464.17	100.00%

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	84,868.82	70.94%	41,092.62	100.00%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	15,127.18
其中：支付销售机构的客户维护费	31,099.41

注：1. 本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.15% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = (前一日基金资产净值 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.15% / 当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,042.27

注：本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人招商银行的托管

费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数, 则取零)的 0.05% 年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为:

日托管费 = (前一日基金资产净值 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.05% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时中证 500ETF 联接 A	博时中证 500ETF 联接 C	合计
招商证券	-	130.96	130.96
招商银行	-	12,207.03	12,207.03
博时基金	-	81,201.01	81,201.01
合计	-	93,539.00	93,539.00

注: A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费 C 类按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付给博时基金, 再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

C 类日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位: 份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	博时中证 500ETF 联接 A	博时中证 500ETF 联接 C
期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-

减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	10,000,000.00	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.07%	—

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	230,600,442.51	52,794.22

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有 55,339,128 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 30.52%。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动式指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所表征的市场组合相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；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良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；

在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.00% (2019 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的

开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资和资产支持证券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	230,600,442.51	-	-	-	230,600,442.51
结算备付金	5,275,173.35	-	-	-	5,275,173.35
存出保证金	1,307,770.34	-	-	-	1,307,770.34
交易性金融资产	2,001,000.00	-	-	330,059,472.06	332,060,472.06
应收证券清算款	-	-	-	3,859,204.00	3,859,204.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	29,598.10	29,598.10
应收申购款	-	-	-	13,898,965.17	13,898,965.17
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	239,184,386.20	-	-	347,847,239.33	587,031,625.53
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	222,258,805.27	222,258,805.27
应付证券清算款	-	-	-	5,937,216.10	5,937,216.10
应付管理人报酬	-	-	-	3,738.11	3,738.11
应付托管费	-	-	-	1,246.03	1,246.03
应付销售服务费	-	-	-	79,358.18	79,358.18
应交税费	-	-	-	448,113.23	448,113.23
应付交易费用	-	-	-	41,092.62	41,092.62
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	79,499.45	79,499.45
负债总计	-	-	-	228,849,068.99	228,849,068.99
利率敏感度缺口	239,184,386.20	-	-	118,998,170.34	358,182,556.54
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	37,913,011.63	-	-	-	37,913,011.63
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,791.30	3,791.30

应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	37,913,011.63	-	-	3,791.30	37,916,802.93
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	155.82	155.82
应付托管费	-	-	-	51.94	51.94
应付销售服务费	-	-	-	157.83	157.83
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	365.59	365.59
利率敏感度缺口	37,913,011.63	-	-	3,425.71	37,916,437.34

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值比例为 0.56%（2019 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的基金和股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，减小与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差，也可以通过二级市场交易买卖目标

ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中目标 ETF 资产占基金资产净值的比例不低于 90%，基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	376,617.00	0.11	—	—
交易性金融资产—基金投资	329,682,855.06	92.04	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
合计	330,059,472.06	92.15	—	—

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位：人民币万元)	
		本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,623	—
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,623	—

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 330,059,472.06 元，属于第二层次的余额为 2,001,000.00 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：本基金未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	376,617.00	0.06
	其中：股票	376,617.00	0.06
2	基金投资	329,682,855.06	56.16
3	固定收益投资	2,001,000.00	0.34
	其中：债券	2,001,000.00	0.34
	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	235,875,615.86	40.18
8	其他各项资产	19,095,537.61	3.25
9	合计	587,031,625.53	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	股票指数型	交易型开放式指数基金	博时基金管理有限公司	329,682,855.06	92.04

7.3 报告期末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	227,845.00	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	137,132.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	11,640.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-

	合计	376,617.00	0.11
--	----	------------	------

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	002317	众生药业	12,000	205,920.00	0.06
2	002640	跨境通	20,000	129,800.00	0.04
3	300474	景嘉微	300	20,190.00	0.01
4	001872	招商港口	800	11,640.00	0.00
5	000025	特力 A	400	7,332.00	0.00
6	002946	新乳业	100	1,735.00	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产 净值比例 (%)
1	002821	凯莱英	1,045,822.00	2.76
2	002384	东山精密	929,756.51	2.45
3	002463	沪电股份	858,456.00	2.26
4	300088	长信科技	846,932.00	2.23
5	300253	卫宁健康	833,134.00	2.20
6	002129	中环股份	822,694.00	2.17
7	002371	北方华创	816,287.00	2.15
8	300014	亿纬锂能	812,559.00	2.14
9	002065	东华软件	797,949.00	2.10
10	000066	中国长城	766,227.00	2.02
11	002439	启明星辰	763,690.00	2.01
12	300383	光环新网	744,329.00	1.96
13	002812	恩捷股份	719,486.00	1.90
14	002180	纳思达	717,668.00	1.89
15	002049	紫光国微	706,994.47	1.86
16	002465	海格通信	684,972.00	1.81
17	002340	格林美	675,265.74	1.78
18	300207	欣旺达	647,074.00	1.71
19	002273	水晶光电	630,555.33	1.66
20	300012	华测检测	623,975.00	1.65

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002821	凯莱英	1,041,599.00	2.75
2	300253	卫宁健康	775,218.50	2.04
3	002127	南极电商	733,761.63	1.94
4	002131	利欧股份	600,613.00	1.58
5	002185	华天科技	592,401.00	1.56
6	300088	长信科技	583,929.00	1.54
7	300285	国瓷材料	562,593.00	1.48
8	002439	启明星辰	557,091.00	1.47
9	002385	大北农	556,376.00	1.47
10	300558	贝达药业	543,547.00	1.43
11	002465	海格通信	524,253.00	1.38
12	002074	国轩高科	511,631.65	1.35
13	300012	华测检测	511,220.00	1.35
14	002075	沙钢股份	508,238.00	1.34
15	300357	我武生物	477,351.00	1.26
16	000009	中国宝安	474,565.00	1.25
17	002223	鱼跃医疗	468,371.00	1.24
18	002507	涪陵榨菜	466,193.00	1.23
19	002212	南洋股份	455,098.00	1.20
20	002273	水晶光电	447,487.00	1.18

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	89,854,122.80
卖出股票的收入（成交）总额	73,749,880.65

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,001,000.00	0.56
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,001,000.00	0.56

7.7 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019627	20 国债 01	20,000	2,001,000.00	0.56

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 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	公允价值变动	风险说明
IC2012	IC2012	8.00	8,794,560.00	91,680.00	-
公允价值变动总额合计					91,680.00
股指期货投资本期收益					1,783,689.31
股指期货投资本期公允价值变动					91,680.00

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行操作。

7.12 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,307,770.34
2	应收证券清算款	3,859,204.00
3	应收股利	-
4	应收利息	29,598.10
5	应收申购款	13,898,965.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,095,537.61

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.13.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时中证500ETF 联	13,261	11,876.80	31,045,145.32	19.71%	126,453,075.04	80.29%

接 A						
博时中证 500ETF 联接 C	26,337	6,388.85	97,566,178.79	57.98%	70,696,931.85	42.02%
合计	39,035	8,345.37	128,611,324.11	39.48%	197,150,006.89	60.52%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时中证 500ETF 联接 A	54,103.31	0.03%
	博时中证 500ETF 联接 C	10,107.30	0.01%
	合计	64,210.61	0.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时中证 500ETF 联接 A	—
	博时中证 500ETF 联接 C	—
	合计	—
本基金基金经理持有本开放式基金	博时中证 500ETF 联接 A	—
	博时中证 500ETF 联接 C	—
	合计	—

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；

2、本基金的基金经理未持有本基金。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	3.07%	10,000,000.00	3.07%	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,000,000.00	3.07%	10,000,000.00	3.07%	—

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时中证 500ETF 联接 A	博时中证 500ETF 联接 C
基金合同生效日（2019 年 12 月 30 日）基金份额总额	18,711,371.13	19,201,640.50
本报告期期初基金份额总额	18,711,371.13	19,201,640.50
本报告期基金总申购份额	628,550,934.29	409,107,588.00
减：本报告期基金总赎回份额	489,764,085.06	260,046,117.86
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	157,498,220.36	168,263,110.64

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：1、基金管理人于 2020 年 1 月 10 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张光华先生不再担任公司董事长职务，由公司总经理江向阳先生代为履行董事长职务。2、基金管理人于 2020 年 4 月 17 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，江向阳先生任博时基金管理有限公司董事长。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	116,048,143.98	70.94%	84,868.82	70.94%	新增 2 个
国泰君安	1	30,654,618.27	18.74%	22,415.13	18.74%	-
中信建投	1	16,891,296.20	10.33%	12,354.07	10.33%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48 号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-	838,419,464.17	100.00%
国	2,003,200.00	100.00%	-	-	-	-	-	-

泰君安								
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于暂停使用中国银行理财直付服务办理直销网上交易部分业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
2	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
3	关于博时旗下部分基金参加招商银行申购及定投业务费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-01
4	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更新招募说明书（正文）	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-05-29
5	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更新招募说明书（摘要）	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-05-29
6	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 2020 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-04-22
7	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-04-17
8	关于博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金开通直销网上交易定期投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-02-12
9	博时基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间暂停办理申购赎回等业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-28
10	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开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-15

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	

者类别	号	比例达到或者超过 20%的时间区间					比
机构	1	2020-01-01~2020-02-13	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	3.07%
	2	2020-05-21~2020-06-30	-	292,290,635.85	195,776,202.96	96,514,432.89	29.63%

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 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发起式联接基金设立的文件

12.1.2 《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基金合同》

12.1.3 《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托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.1.5 报告期内博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 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
二〇二〇年八月三十一日