

博时标普 500 交易型开放式指数证券投资 资基金

2019 年年度报告
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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年三月二十七日

§ 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。本年度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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 月 25 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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	5
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	7
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	12
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.10 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.....	15
§5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 审计报告.....	16
6.1 审计意见.....	16
6.2 形成审计意见的基础.....	17
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	17
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	17
§7 年度财务报表.....	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告.....	42
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	42
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	43

8.4 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	43
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动	60
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	61
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	61
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	61
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	61
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	62
8.11 投资组合报告附注	62
§9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末上市基金前十名持有人	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
9.4 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	63
§10 开放式基金份额变动	63
§11 重大事件揭示	64
11.1 基金份额持有人大会决议	64
11.2 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	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	65
§12 影响投资者决策的其他重要信息	68
12.1 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	68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§13 备查文件目录	69
13.1 备查文件目录	69
13.2 存放地点	69
13.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时标普 500ETF
场内简称	证券简称：标普 500，扩位证券简称：标普 500ETF
基金主代码	513500
交易代码	513500
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2013 年 12 月 5 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	700,819,285.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2014 年 1 月 15 日

2.2 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	本基金主要采取完全复制法实现对标的指数的紧密跟踪。 同时，为了更好地实现本基金的投资目标，本基金可适当借出证券。 为了减轻由于现金拖累产生的跟踪误差，本基金将用少量资产投资跟踪同一标的指数的股指期货，以达到最有效跟踪标的指数的投资目标。
业绩比较基准	标普 500 指数 (S&P 500 Index (NTR, Net total Return)) (经估值汇率调整，以人民币计价)
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，属于高预期风险和高预期收益的基金品种。 本基金主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数相似。本基金主要投资于美国证券市场的股票，投资者需承担汇率风险。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	郭明
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区	北京市西城区复兴门内大街55号

	区益田路5999号基金大厦21层	
办公地址	广东省深圳市福田区益田路 5999号基金大厦21层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	518040	100140
法定代表人	张光华	陈四清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Brown Brothers Harriman Co.
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		-	-

2.5 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	29,584,613.18	20,553,505.81	8,018,931.55
本期利润	259,592,371.57	-34,080,299.75	45,252,291.65
加权平均基金份额本期利润	0.5035	-0.0991	0.1814
本期加权平均净值利润率	26.60%	-5.83%	11.85%
本期基金份额净值增长率	31.64%	-1.18%	13.02%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	224,910,095.57	115,789,755.88	58,182,542.85

期末可供分配基金份额利润	0.3209	0.2639	0.2065
期末基金资产净值	1,477,921,261.68	702,935,967.50	456,821,477.98
期末基金份额净值	2.1088	1.6019	1.6210
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	110.88%	60.19%	62.10%

注：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

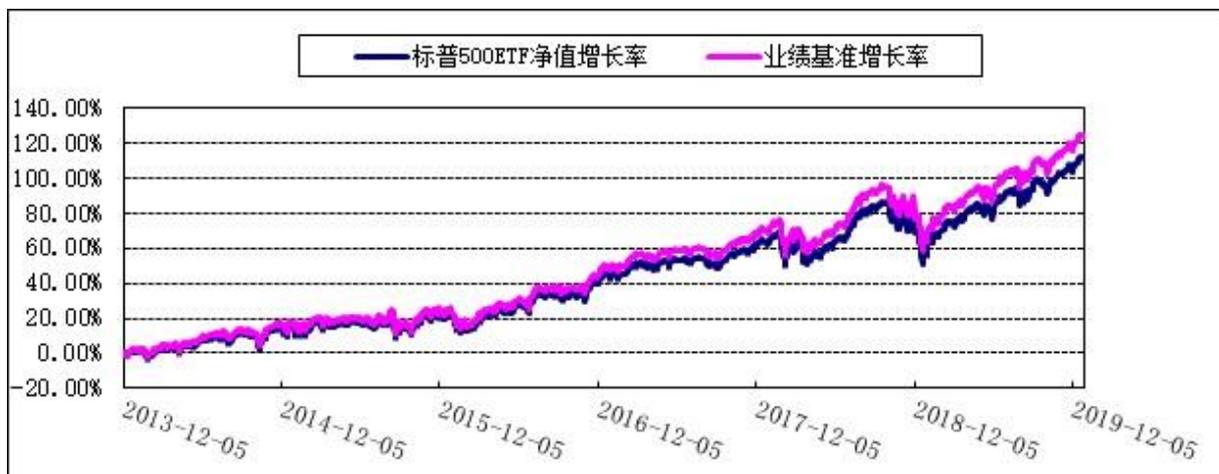
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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
过去三个月	7.17%	0.59%	7.42%	0.59%	-0.25%	0.00%
过去六个月	11.57%	0.79%	12.22%	0.79%	-0.65%	0.00%
过去一年	31.64%	0.80%	32.85%	0.80%	-1.21%	0.00%
过去三年	47.03%	0.84%	51.30%	0.85%	-4.27%	-0.01%
过去五年	84.89%	0.88%	92.21%	0.88%	-7.32%	0.00%
自基金合同生效起至今	110.88%	0.84%	123.73%	0.85%	-12.85%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为：标普 500 指数（S&P 500 Index (NTR, Net total Return)）（经估值汇率调整，以人民币计价）

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

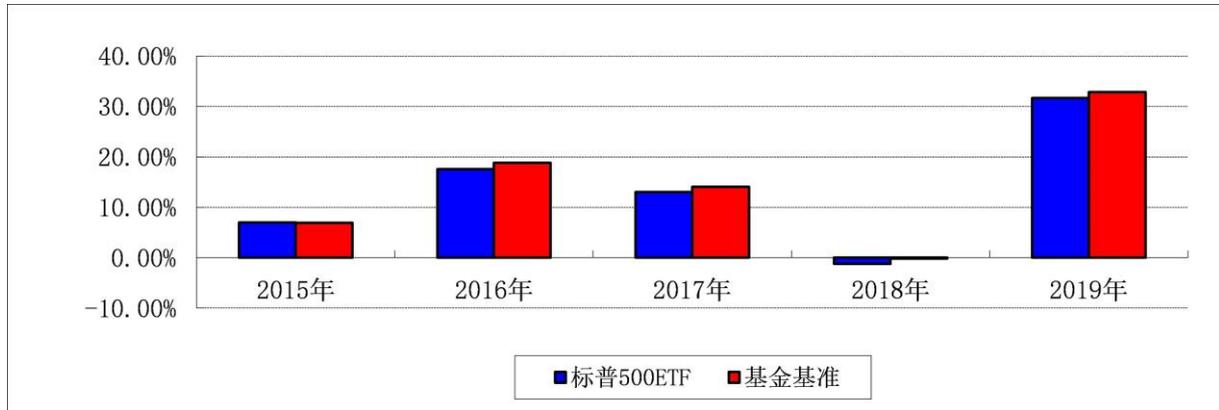
博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013 年 12 月 5 日至 2019 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比如



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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，“做投资价值的发现者”是博时的理念。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 年净值增长率均同类排名第 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)、博时中证银联智惠大数据 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) 同类排名分别排在第 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) 同类排名分别排在第 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”评选活动圆满结束,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“精准扶贫先锋机构”奖。

2019 年 9 月 27 日,《证券时报》主办的“2019 中国 AI 金融探路者峰会暨第三届中国金融科技先锋榜”颁奖典礼在深圳举行,博时基金凭借“新一代投资决策支持平台”项目,获登“中国公募基金智能投研先锋榜”。

2019 年 8 月 17 日,第二届济安五星基金“群星汇”暨颁奖典礼在京举行,博时基金斩获基金公司综合奖“群星奖”、“众星奖”、“五星奖”,基金产品单项奖“货币型基金管理奖”、“QDII 基金管理奖”以及 2 项“五星基金明星奖”等 7 项大奖,彰显出老牌基金公司强大的实力底蕴。

2019 年 7 月 5 日,2019 金牛基金高峰论坛暨第十六届中国基金金牛奖颁奖典礼在北京进行,博时基金研究部总经理王俊和固定收益总部专户组投资总监张李陵分别获得“人气金牛”奖项,两位各自管理的绩优产品博时主题行业混合(LOF)(160505)和博时信用债纯债债券(050027)分别荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖和“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2019 年 6 月 20 日,由中国基金报独家主办的第六届中国基金业“英华奖”评选隆重揭晓,博时基金在此次英华奖中揽获 6 项最佳基金经理大奖。其中,博时基金蔡滨拿下“三年期股票投资最

佳基金经理”；陈凯杨荣膺“五年期纯债投资最佳基金经理”；何凯则一举揽获“三年期海外固收投资最佳基金经理”和“五年期海外固收投资最佳基金经理”两项桂冠；过钧则再度获得“三年期二级债投资最佳基金经理”和“五年期二级债投资最佳基金经理”称号。

2019 年 4 月 25 日，由上海证券报主办的第十六届“金基金”奖的评选结果如期揭晓，博时基金在评选中一举夺得最具份量的公司奖项“2018 年度金基金·TOP 公司”奖，博时主题行业(160505)继去年获得“三年期金基金分红”奖，后拿下“2018 年度金基金·十年期偏股混合型基金”奖，同时，博时裕瑞纯债债券(001578)获得“2018 年度金基金·一年期债券基金”奖。

2019 年 4 月 14 日，第十六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主题行业混合(LOF)(160505)荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖；博时信用债纯债债券(050027)荣获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2019 年 3 月 21 日，由证券时报主办的第六届中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛在北京隆重举行，同时第十四届中国基金业明星基金奖和中国公募基金首届英华奖也随之揭晓。博时基金凭借出色的资产管理能力和优秀的业绩表现，一举摘得“2018 年度十大明星基金公司”称号。在英华奖的评选中，博时基金在获评“2018 年度最佳电商业务发展基金公司”奖的同时，还凭借博时基金 20 周年品牌传播项目拿下了“2018 年度最佳营销策划案例(最佳综合)”奖。此外，博时慈善基金会公益助学项目获得了“2018 年度最佳社会公益实践案例”。在产品奖方面，助力央企结构转型和改革的博时央企结构调整 ETF 获评英华奖“2018 年度最佳创新基金产品”；博时裕瑞纯债债券获得“2018 年度普通债券型明星基金”奖；博时宏观回报债券则凭借同类可比基金第一的佳绩喜获“2018 年度积极债券型明星基金”奖；博时亚洲票息收益债券(QDII)、博时双月薪定期支付债券双双以过去五年稳居同类前列的好成绩分别拿下“五年持续回报 QDII 明星基金”、“五年持续回报普通债券型明星基金”称号；博时裕恒纯债债券则摘得“三年期持续回报普通债券型明星基金”奖。

2019 年 2 月 25 日，博时国际在“投资洞见与委托”(Insights&Mandate)举办的第二届专业投资奖评选活动中荣获“2019 年度最佳机构法人投资经理”，并凭借博时国际于 2018 年 5 月 10 日共同成立的“博时—东方红大中华债券基金”获“最佳创新产品”大奖。

2019 年 1 月 23 日，由深圳市福田区金融发展事务署首届举办的“香蜜湖金融科技创新奖”颁奖典礼在深圳福田隆重举行，《博时基金基于大数据技术升级量化投资技术》项目荣获优秀项目奖，博时基金采用金融科技为业务赋能的创新成果获得行业和地方政府高度认可。

2019 年 1 月 11 日，中央国债登记结算有限责任公司(以下简称“中债登”)公布了《2018 年度中债优秀成员评选结果》。凭借在债券市场上的深厚积淀和优异的投研业绩，博时基金获评年度“优秀资产管理人”称号，全行业获此殊荣的基金公司仅有 10 家。

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	2015-10-08	-	12.9	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 日一至今)、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)的基金经理。
汪洋	指数与量化投资部副总经理/基金经理	2016-05-16	-	10.7	汪洋先生，硕士。2009 年起先后在华泰联合证券、华泰柏瑞基金、汇添富基金工作。2015 年加入博时基金管理有限公司。历任指数投资部总经理助理、指数投资部副总经理。现任指数与量化投资部副总经理兼博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2016 年 5 月 16 日一至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2016 年 5 月 16 日一至今)、博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金(2016 年 5 月 16 日一至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2016 年 5 月 16 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了《公平交易管理制度》，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.4.2 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。

4.4.3 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 144 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年，美国经济依旧强劲，美股大幅上涨。美国四季度实际 GDP 增长初值 2.1%，与三季度持平。从经济基本上来看，美国劳动力市场稳健，经济向好。2019 年 3-12 月新增就业数据上修，2019 年 3-12 月期间的新增就业被上修 9.2 万人，显示 2019 年后期就业增长比此前看起来更好，经济动能更加强劲。美国住宅建筑业景气，住宅房屋销售和预测未来住宅建筑强势。住宅房屋销售和预测未来住宅建筑前景良好，12 月新宅开工指数远超预期。从需求端看，MBA 抵押贷款申请指数环比上升 30.2%，房地产市场表现生机勃勃。此外，美国零售数据良好，保持稳步增长。从货币政策

方面来看，美联储自 2019 年 7 月会议开始连续 3 次降息共 75bps，实际联邦基金利率重回零以下。美联储的降息周期暂停难言结束。从市场情绪上来看，2019 年美股大幅上涨，标普 500 指数涨幅接近 30%。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 2.1088 元，份额累计净值为 2.1088 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 31.64%，同期业绩基准增长率 32.85%。

4.6 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，美国经济存在比较大的不确定性。从目前最新的经济数据来看，劳动力市场稳健，就业市场依然强劲，新增非农就业仍然大幅超预期。房地产市场仍在缓慢恢复，基础稳固，处于温和扩张状态。1 月房地产市场持续强劲，或可预计 2 月美国房地产市场仍较稳固。但是新冠疫情的影响超出预期，短期市场对疫情反映较为剧烈，投资者对疫情无法控制仍存在较大的担忧。美联储将基准利率降至 0，并启动 7000 亿美元量宽计划，刺激市场流动性。短期来看，疫情对经济的冲击较大，甚至不排除出现一定的衰退，目前金融体系内部尚未出现问题，进入金融危机模式概率仍然较低。后续仍然需要关注疫情发展及美国大选进程。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

2019 年，我公司根据法律、法规的规定，制定了《基金中基金投资管理办法》、《科创板投资管理制度》、《反洗钱政策手册》等制度文件。修订了《博时基金管理有限公司章程》、《法定信息披露制度及流程》等制度文件，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断建设及完善“新一代投资决策支持系统”、“博时客户关系管理系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.8 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、风险管理部负责人、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。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的收益分配原则：基金收益每年最多分配 2 次。每次基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后可能使除息后的基金份额净值低于面值。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。

4.10 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

无。

§ 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

本报告期内，本基金托管人在对博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，

严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2020)第 23129 号

博时标普500交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“博时标普 500ETF”)的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了博时标普 500ETF 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博时标普 500ETF，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

博时标普 500ETF 的基金管理人博时基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估博时标普 500ETF 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算博时标普 500ETF、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督博时标普 500ETF 的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对博时标普 500ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博时标普 500ETF 不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师
张振波 沈兆杰
上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
2020 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	93,109,307.81	32,282,134.03
结算备付金		17,931,023.37	4,897,835.45
存出保证金		3,340,204.56	1,441,272.00
交易性金融资产	7.4.7.2	1,386,339,745.15	671,183,717.63
其中：股票投资		1,386,339,745.15	671,183,717.63
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		94,660.46	-
应收利息	7.4.7.5	6,758.85	7,703.61
应收股利		1,202,281.17	679,932.21
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,502,023,981.37	710,492,594.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
负债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		22,712,296.98	6,668,991.27
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		695,490.82	357,802.48
应付托管费		289,787.81	149,084.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		32,255.95	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	372,888.13	380,749.33
负债合计		24,102,719.69	7,556,627.43
所有者权益:		-	-
实收基金	7.4.7.9	700,819,285.00	438,819,285.00
未分配利润	7.4.7.10	777,101,976.68	264,116,682.50
所有者权益合计		1,477,921,261.68	702,935,967.50
负债和所有者权益总计		1,502,023,981.37	710,492,594.93

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.1088 元，基金份额总额 700,819,285.00 份。

7.2 利润表

会计主体：博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年12月31日

一、收入		268,895,883.51	-27,893,690.78
1. 利息收入		341,969.52	141,972.12
其中：存款利息收入	7.4.7.11	341,969.52	141,972.12
债券利息收入		-	-
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)		40,322,577.04	28,016,113.11
其中：股票投资收益	7.4.7.12	11,883,338.79	20,295,267.69
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	8,993,889.85	-2,486,068.65
股利收益	7.4.7.16	19,445,348.40	10,206,914.07
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	230,007,758.39	-54,633,805.56
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-2,293,921.31	-244,382.10
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	517,499.87	-1,173,588.35
减：二、费用		9,303,511.94	6,186,608.97
1. 管理人报酬		5,851,707.15	3,514,070.45
2. 托管费		2,438,211.29	1,464,195.95
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	165,506.51	145,460.60
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		32,370.33	8,922.99
7. 其他费用	7.4.7.20	815,716.66	1,053,958.98
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		259,592,371.57	-34,080,299.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		259,592,371.57	-34,080,299.75

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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)	438,819,285.00	264,116,682.50	702,935,967.50

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	259,592,371.57	259,592,371.57
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）	262,000,000.00	253,392,922.61	515,392,922.61
其中：1. 基金申购款	427,000,000.00	394,353,810.33	821,353,810.33
2. 基金赎回款	-165,000,000.00	-140,960,887.72	-305,960,887.72
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）	700,819,285.00	777,101,976.68	1,477,921,261.68
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	281,819,285.00	175,002,192.98	456,821,477.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-34,080,299.75	-34,080,299.75
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）	157,000,000.00	123,194,789.27	280,194,789.27
其中：1. 基金申购款	289,000,000.00	214,756,779.86	503,756,779.86
2. 基金赎回款	-132,000,000.00	-91,561,990.59	-223,561,990.59
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）	438,819,285.00	264,116,682.50	702,935,967.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(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[2013]750 号《关于核准博时标普 500 交易型开放式证券投资基金募集的批复》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《博时标普 500 交易型开放式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 565,038,000.00 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(2013)第 743 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,

《博时标普 500 交易型开放式证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 565,043,200.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 5,200.00 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期间不定，本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、境外上市交易的跟踪同一标的指数的公募基金。本基金还可投资于依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生工具、法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的标的指数为标普 500 净总收益指数(S&P500 Index(Net TR))。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2020 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 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》、《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年度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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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和衍生工具投资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其他各类应付款项等。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。当本基金依法 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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，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。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》及其他相关境内外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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
活期存款	93,109,307.81	32,282,134.03
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	93,109,307.81	32,282,134.03

注：于2019年12月31日，银行存款中包含的外币余额为美元9,580,678.18元(折合人民币66,836,727.12元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,121,203,087.35	1,386,339,745.15	265,136,657.80
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,121,203,087.35	1,386,339,745.15	265,136,657.80
项目	上年度末 2018年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	635,322,658.80	671,183,717.63	35,861,058.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-

	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	635,322,658.80	671,183,717.63	35,861,058.83

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31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	84,369,805.47	-	-	-
—股指期货	84,369,805.47	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	84,369,805.47	-	-	-
项目	上年度末 2018年12月31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	29,139,558.66	-	-	-
—股指期货	29,139,558.66	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	29,139,558.66	-	-	-

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投资产生的持仓损益，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2019年12月31日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

期货类型	期货代码	期货名称	持仓量(买/卖)	合约价值 (人民币元)	公允价值变动 (人民币元)
股指期货	ESH0	S&P500 EMINI FUT Mar20	76	85,655,039.32	1,763,269.43
总额合计					1,763,269.43
减：可抵消期货暂收款					1,763,269.43
股指期货投资净额					-

于2018年12月31日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

期货类型	期货代码	期货名称	持仓量(买/卖)	合约价值 (人民币元)	公允价值变动 (人民币元)
股指期货	ESH9	S&P500 EMINI FUT Mar19	35	30,088,955.12	1,031,110.01
总额合计					1,031,110.01
减：可抵消期货暂收款					1,031,110.01
股指期货投资净额					-

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	4,889.41	6,435.72
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	1,869.44	1,267.89
应收债券利息	-	-
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	6,758.85	7,703.61

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

无余额。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
预提费用	170,000.00	350,000.00
应付标普指数使用费	202,888.13	30,749.33
合计	372,888.13	380,749.33

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	438,819,285.00	438,819,285.00
本期申购	427,000,000.00	427,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-165,000,000.00	-165,000,000.00
本期末	700,819,285.00	700,819,285.00

7.4.7.10 未分配利润

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	115,789,755.88	148,326,926.62	264,116,682.50
本期利润	29,584,613.18	230,007,758.39	259,592,371.57
本期基金份额交易产生的变动数	79,535,726.51	173,857,196.10	253,392,922.61
其中：基金申购款	127,073,879.68	267,279,930.65	394,353,810.33
基金赎回款	-47,538,153.17	-93,422,734.55	-140,960,887.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	224,910,095.57	552,191,881.11	777,101,976.68

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
	活期存款利息收入	227,556.53
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	114,412.99	8,245.72
其他	-	-
合计	341,969.52	141,972.12

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
	卖出股票成交总额	93,140,603.47
减：卖出股票成本总额	81,257,264.68	123,133,893.06
买卖股票差价收入	11,883,338.79	20,295,267.69

7.4.7.13 基金投资收益

无发生额。

7.4.7.14 债券投资收益

无发生额。

7.4.7.15 衍生工具收益
7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年12月31日
卖出权证成交总额	103.51	-
减：卖出权证成本总额	-	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	3.02	-
买卖权证差价收入	100.49	-

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年12月31日
期货投资收益	8,993,789.36	-2,486,068.65
合计	8,993,789.36	-2,486,068.65

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31 日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31 日
股票投资产生的股利收益	19,445,348.40	10,206,914.07
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	19,445,348.40	10,206,914.07

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
1. 交易性金融资产	229,275,598.97	-55,471,339.89
——股票投资	229,275,598.97	-55,471,339.89
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	732,159.42	837,534.33

——权证投资	-	-
——期货投资	732,159.42	837,534.33
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	230,007,758.39	-54,633,805.56

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
替代损益	517,499.87	-1,173,588.35
合计	517,499.87	-1,173,588.35

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
交易所市场交易费用	165,506.51	145,460.60
银行间市场交易费用	-	-
合计	165,506.51	145,460.60

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	300,000.00
证券出借违约金	-	-
标普指数使用费	585,028.66	643,039.04
上市费	60,000.00	60,000.00
银行汇划费用	688.00	919.94
合计	815,716.66	1,053,958.98

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费。指数使用费取按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率每日计提金额及按指数使用协议规定的费用下限 10 万美元均摊到每日计提的累计金额的孰高者。自 2018 年 12 月 14 日起指数使用费取按前一日基金资产净值的 0.06% 的年费率每日计提金额及按指数使用协议规定的费用下限 6 万美元均摊到每日计提的累计金额的孰高者。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
布朗兄弟哈里曼银行(“BBH”)	境外资产托管人
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人的子公司
招商证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(博时标普 500ETF 联接”)	基金管理人管理的其他基金

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,851,707.15	3,514,070.45
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金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 0.60% 的年费率计提，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 × 0.60% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,438,211.29	1,464,195.95

注：本基金支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
招商证券股份有限公司	1,124,382.00	0.16%	1,308,283.00	0.30%
博时标普 500ETF 联接	480,599,160.00	68.58%	248,499,160.00	56.63%

7.4.10.6 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 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	26,273,297.01	227,556.53	29,314,374.69	133,726.40
BBH	66,836,010.80	-	2,967,759.34	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，其中由中国工商银行保管的银行存款按适用利率计息，由布朗兄弟哈里曼银行保管的银行存款不计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式投资的交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标普 500 指数成份股，具有和标的指数所代表的股票市场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。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪标普 500 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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及绩效分析工作，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，将风险控制可在承受的范围内。

7.4.13.2 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行及境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内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，违约风险不重大。在场外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。本基金投资于远期合约时，任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

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 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例为 0.00%（2018 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.3 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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

7.4.13.3.1 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发行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可

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 7.4.12。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 2019 年 12 月 31 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 2019 年 12 月 31 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、结算备付金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	26,273,297.01	-	-	66,836,010.80	93,109,307.81
结算备付金	4,642,171.68	-	-	13,288,851.69	17,931,023.37
存出保证金	-	-	-	3,340,204.56	3,340,204.56
交易性金融资产	-	-	-	1,386,339,745.15	1,386,339,745.15
应收利息	-	-	-	6,758.85	6,758.85
应收股利	-	-	-	1,202,281.17	1,202,281.17
其他资产	-	-	-	94,660.46	94,660.46
资产总计	30,915,468.69	-	-	1,471,108,512.68	1,502,023,981.37
负债					
应付证券清算款	-	-	-	22,712,296.98	22,712,296.98
应付管理人报酬	-	-	-	695,490.82	695,490.82
应付托管费	-	-	-	289,787.81	289,787.81
应交税费	-	-	-	32,255.95	32,255.95
其他负债	-	-	-	372,888.13	372,888.13
负债总计	-	-	-	24,102,719.69	24,102,719.69
利率敏感度缺口	30,915,468.69	-	-	1,447,005,792.99	1,477,921,261.68
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	29,314,374.69	-	-	2,967,759.34	32,282,134.03
结算备付金	-	-	-	4,897,835.45	4,897,835.45
存出保证金	-	-	-	1,441,272.00	1,441,272.00
交易性金融资产	-	-	-	671,183,717.63	671,183,717.63
应收利息	-	-	-	7,703.61	7,703.61
应收股利	-	-	-	679,932.21	679,932.21
资产总计	29,314,374.69	-	-	681,178,220.24	710,492,594.93
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	357,802.48	357,802.48
应付托管费	-	-	-	149,084.35	149,084.35
其他负债	-	-	-	7,049,740.60	7,049,740.60
负债总计	-	-	-	7,556,627.43	7,556,627.43
利率敏感度缺口	29,314,374.69	-	-	673,621,592.81	702,935,967.50

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予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例为 0.00% (2018 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 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

持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
银行存款	66,836,727.12	66,836,727.12
结算备付金	13,288,851.69	13,288,851.69
存出保证金	3,340,204.56	3,340,204.56
交易性金融资产	1,386,339,745.15	1,386,339,745.15
应收股利	1,202,281.17	1,202,281.17
资产合计	1,471,007,809.69	1,471,007,809.69
以外币计价的负债		
应付证券清算款	20,178,491.91	20,178,491.91
其他负债	202,888.13	202,888.13
负债合计	20,381,380.04	20,381,380.04
资产负债表外汇风险敞口净额	1,450,626,429.65	1,450,626,429.65
项目	上年度末 2018年12月31日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
银行存款	2,968,305.51	2,968,305.51
结算备付金	4,897,835.45	4,897,835.45
存出保证金	1,441,272.00	1,441,272.00
交易性金融资产	671,183,717.63	671,183,717.63
应收股利	679,932.21	679,932.21
资产合计	681,171,062.80	681,171,062.80
以外币计价的负债		
其他负债	30,749.33	30,749.33
负债合计	30,749.33	30,749.33
资产负债表外汇风险敞口净额	681,140,313.47	681,140,313.47

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日

	所有外币均相对人民币升值 5%	增加约 7,253	增加约 3,406
	所有外币均相对人民币贬值 5%	减少约 7,253	减少约 3,406

7.4.13.4.3 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。

本基金采用完全复制法，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。针对股指期货等高风险的金融衍生工具，管理人会每日对股指期货已占用保证金占总可用资金比例，股指期货账户未占用保证金占总期货账户权益比例，持仓占套保额度上限比例，以及股指期货合约成交金额占上一交易日基金资产净值比例，持有的买入、卖出股指期货合约占基金资产净值比例，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和占基金资产比例等法律法规、基金合同约定的合规、风险比例进行严格监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 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	1,386,339,745.15	93.80	671,183,717.63	95.48
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,386,339,745.15	93.80	671,183,717.63	95.48

注：于 2019 年 12 月 31 日，本基金还持有衍生金融工具，具体信息请参考附注 7.4.7.3 衍生金融资产/负债。(2018 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 7,462	增加约 3,300
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 7,462	减少约 3,300

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2019 年度,本基金申购基金份额的对价总额为 821,353,810.33 元(2018 年度:503,756,779.86 元),均为以现金支付的申购款(2018 年度:同)。

(2) 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 2019 年 12 月 31 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 1,386,339,745.15 元,无属于第二层次和第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日:属于第一层次的余额为 671,183,717.63 元,无属于第二层次和第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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 2019 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 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。

(3) 除公允价值和基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	1,386,339,745.15	92.30
	其中：普通股	1,346,782,273.01	89.66
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	39,557,472.14	2.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	111,040,331.18	7.39
8	其他各项资产	4,643,905.04	0.31
9	合计	1,502,023,981.37	100.00

注：金融衍生品投资项下的期货投资，在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货结算暂收款（结算所得的持仓损益）相抵消后的净额为 0，具体投资情况详见 7.4.7.3 衍生金融资产/负债。

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	1,386,339,745.15	93.80
合计	1,386,339,745.15	93.80

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
能源	60,329,588.52	4.08
原材料	35,191,368.24	2.38
工业	125,629,816.64	8.50
非日常生活消费品	135,244,025.17	9.15
日常消费品	99,991,043.25	6.77
医疗保健	197,147,627.74	13.34
金融	179,778,701.50	12.16
信息技术	322,030,489.97	21.79
电信业务	144,252,951.67	9.76
公用事业	46,122,435.35	3.12
房地产	40,621,697.10	2.75
合计	1,386,339,745.15	93.80

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

8.4 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	APPLE INC	-	AAPL US	纳斯达克交易所	美国	31,062.00	63,632,405.82	4.31
2	MICROSOFT CORP	-	MSFT US	纳斯达克交易所	美国	56,735.00	62,416,825.29	4.22
3	ALPHABET INC-CL A	-	GOOGL US	纳斯达克交易所	美国	2,228.00	20,818,103.41	1.41
3	ALPHABET INC-CL C	-	GOOG US	纳斯达克交易所	美国	2,222.00	20,725,302.65	1.40
4	AMAZON.COM INC	-	AMZN US	纳斯达克交易所	美国	3,097.00	39,923,121.66	2.70
5	FACEBOOK INC-CLASS A	-	FB US	纳斯达克交易所	美国	17,897.00	25,626,088.80	1.73
6	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	-	BRK/B US	纽约证券交易所	美国	14,547.00	22,985,849.99	1.56
7	JPMORGAN CHASE & CO	-	JPM US	纽约证券交易所	美国	23,326.00	22,684,121.66	1.53
8	JOHNSON & JOHNSON	-	JNJ US	纽约证券交易所	美国	19,573.00	19,917,842.87	1.35
9	VISA INC-CLASS A SHARES	-	V US	纽约证券交易所	美国	12,731.00	16,688,151.01	1.13
10	PROCTER & GAMBLE CO/THE	-	PG US	纽约证券交易所	美国	18,546.00	16,159,637.59	1.09
11	EXXON MOBIL CORP	-	XOM US	纽约证券交易所	美国	31,467.00	15,318,111.56	1.04
12	AT&T INC	-	T US	纽约证券交易所	美国	54,327.00	14,811,164.36	1.00
13	BANK OF AMERICA CORP	-	BAC US	纽约证券交易所	美国	60,207.00	14,792,966.11	1.00

14	UNITEDHEALTH GROUP INC	-	UNH US	纽约证券交易所	美国	7,045.00	14,448,331.78	0.98
15	MASTERCARD INC - A	-	MA US	纽约证券交易所	美国	6,602.00	13,752,121.53	0.93
16	WALT DISNEY CO/THE	-	DIS US	纽约证券交易所	美国	13,404.00	13,524,204.47	0.92
17	INTEL CORP	-	INTC US	纳斯达克交易所	美国	32,351.00	13,507,369.72	0.91
18	VERIZON COMMUNICATIONS INC	-	VZ US	纽约证券交易所	美国	30,758.00	13,174,841.12	0.89
19	HOME DEPOT INC	-	HD US	纽约证券交易所	美国	8,112.00	12,358,328.25	0.84
20	MERCK & CO. INC.	-	MRK US	纽约证券交易所	美国	18,934.00	12,013,346.37	0.81
21	CHEVRON CORP	-	CVX US	纽约证券交易所	美国	14,062.00	11,821,949.58	0.80
22	PFIZER INC	-	PFE US	纽约证券交易所	美国	41,157.00	11,249,340.58	0.76
23	COCA-COLA CO/THE	-	KO US	纽约证券交易所	美国	28,677.00	11,073,126.58	0.75
24	WELLS FARGO & CO	-	WFC US	纽约证券交易所	美国	28,623.00	10,742,771.77	0.73
25	COMCAST CORP-CLASS A	-	CMCSA US	纳斯达克交易所	美国	33,762.00	10,591,804.98	0.72
26	CISCO SYSTEMS INC	-	CSCO US	纳斯达克交易所	美国	31,549.00	10,555,618.74	0.71
27	PEPSICO INC	-	PEP US	纳斯达克交易所	美国	10,370.00	9,887,144.32	0.67
28	CITIGROUP INC	-	C US	纽约证券交易所	美国	16,236.00	9,048,787.44	0.61
29	BOEING CO/THE	-	BA US	纽约证券交易所	美国	3,976.00	9,035,726.04	0.61
30	WALMART INC	-	WMT US	纽约证券交易所	美国	10,550.00	8,746,494.46	0.59
31	ADOBE INC	-	ADBE US	纳斯达克交易所	美国	3,600.00	8,282,953.88	0.56
32	ABBOTT LABORATORIES	-	ABT US	纽约证券交易所	美国	13,144.00	7,964,642.71	0.54
33	MEDTRONIC PLC	-	MDT US	纽约证券交易所	美国	9,968.00	7,889,172.50	0.53
34	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	-	BMJ US	纽约证券交易所	美国	17,433.00	7,806,537.11	0.53
35	MCDONALD'S CORP	-	MCD US	纽约证券交易所	美国	5,600.00	7,719,974.54	0.52
36	SALESFORCE.COM INC	-	CRM US	纽约证券交易所	美国	6,596.00	7,483,882.07	0.51
37	NVIDIA CORP	-	NVDA US	纳斯达克交易所	美国	4,551.00	7,470,465.86	0.51
38	AMGEN INC	-	AMGN US	纳斯达克交易所	美国	4,418.00	7,429,982.70	0.50
39	NETFLIX INC	-	NFLX US	纳斯达克交易所	美国	3,259.00	7,356,504.96	0.50
40	ACCENTURE PLC-CL A	-	ACN US	纽约证券交易所	美国	4,723.00	6,937,985.14	0.47
41	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	-	PM US	纽约证券交易所	美国	11,571.00	6,868,601.81	0.46
42	ABBVIE INC	-	ABBV US	纽约证券交易所	美国	10,998.00	6,793,164.88	0.46
43	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	-	TMO US	纽约证券交易所	美国	2,982.00	6,758,279.84	0.46
44	COSTCO WHOLESALE CORP	-	COST US	纳斯达克交易所	美国	3,285.00	6,735,710.85	0.46
45	PAYPAL HOLDINGS INC	-	PYPL US	纳斯达克交易所	美国	8,732.00	6,589,303.02	0.45
46	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	-	HON US	纽约证券交易所	美国	5,314.00	6,561,660.24	0.44
47	NIKE INC -CL B	-	NKE US	纽约证券交易所	美国	9,266.00	6,548,827.24	0.44

48	UNION PACIFIC CORP	-	UNP US	纽约证券交易所	美国	5,162.00	6,510,454.80	0.44
49	BROADCOM INC	-	AVGO US	纳斯达克交易所	美国	2,950.00	6,503,625.24	0.44
50	UNITED TECHNOLOGIES CORP	-	UTX US	纽约证券交易所	美国	6,033.00	6,303,011.21	0.43
51	TEXAS INSTRUMENTS INC	-	TXN US	纳斯达克交易所	美国	6,951.00	6,220,983.03	0.42
52	INTL BUSINESS MACHINES CORP	-	IBM US	纽约证券交易所	美国	6,586.00	6,158,501.74	0.42
53	NEXTERA ENERGY INC	-	NEE US	纽约证券交易所	美国	3,635.00	6,140,811.21	0.42
54	ORACLE CORP	-	ORCL US	纽约证券交易所	美国	16,112.00	5,954,980.31	0.40
55	LINDE PLC	-	LIN US	纽约证券交易所	美国	3,995.00	5,933,505.76	0.40
56	ELI LILLY & CO	-	LLY US	纽约证券交易所	美国	6,283.00	5,760,769.39	0.39
57	STARBUCKS CORP	-	SBUX US	纳斯达克交易所	美国	8,783.00	5,387,031.13	0.36
58	AMERICAN TOWER CORP	-	AMT US	纽约证券交易所	美国	3,294.00	5,281,172.32	0.36
59	3M CO	-	MMM US	纽约证券交易所	美国	4,276.00	5,262,649.39	0.36
60	QUALCOMM INC	-	QCOM US	纳斯达克交易所	美国	8,491.00	5,226,296.48	0.35
61	DANAHER CORP	-	DHR US	纽约证券交易所	美国	4,754.00	5,090,141.91	0.34
62	GENERAL ELECTRIC CO	-	GE US	纽约证券交易所	美国	64,951.00	5,056,720.61	0.34
63	LOCKHEED MARTIN CORP	-	LMT US	纽约证券交易所	美国	1,846.00	5,014,461.03	0.34
64	CVS HEALTH CORP	-	CVS US	纽约证券交易所	美国	9,675.00	5,014,183.86	0.34
65	ALTRIA GROUP INC	-	MO US	纽约证券交易所	美国	13,893.00	4,837,294.50	0.33
66	LOWE'S COS INC	-	LOW US	纽约证券交易所	美国	5,700.00	4,762,177.36	0.32
67	BOOKING HOLDINGS INC	-	BKNG US	纳斯达克交易所	美国	311.00	4,455,768.91	0.30
68	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	-	FIS US	纽约证券交易所	美国	4,570.00	4,434,360.84	0.30
69	US BANCORP	-	USB US	纽约证券交易所	美国	10,570.00	4,371,951.75	0.30
70	AMERICAN EXPRESS CO	-	AXP US	纽约证券交易所	美国	4,990.00	4,333,651.02	0.29
71	GILEAD SCIENCES INC	-	GILD US	纳斯达克交易所	美国	9,408.00	4,264,773.18	0.29
72	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	-	UPS US	纽约证券交易所	美国	5,211.00	4,255,479.63	0.29
73	CATERPILLAR INC	-	CAT US	纽约证券交易所	美国	4,110.00	4,234,307.84	0.29
74	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	-	MDLZ US	纳斯达克交易所	美国	10,708.00	4,114,539.32	0.28
75	ANTHEM INC	-	ANTM US	纽约证券交易所	美国	1,885.00	3,971,735.88	0.27
76	CIGNA CORP	-	CI US	纽约证券交易所	美国	2,777.00	3,961,565.83	0.27
77	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	-	CHTR US	纳斯达克交易所	美国	1,166.00	3,945,761.60	0.27
78	TRUIST FINANCIAL CORP	-	TFC US	纽约证券交易所	美国	9,973.00	3,918,387.55	0.27

79	TJX COMPANIES INC	-	TJX US	纽约证券交易所	美国	9,018.00	3,841,368.35	0.26
80	AUTOMATIC DATA PROCESSING	-	ADP US	纳斯达克交易所	美国	3,218.00	3,827,624.68	0.26
81	BECTON DICKINSON AND CO	-	BDX US	纽约证券交易所	美国	2,011.00	3,815,504.72	0.26
82	GOLDMAN SACHS GROUP INC	-	GS US	纽约证券交易所	美国	2,370.00	3,801,569.27	0.26
83	CME GROUP INC	-	CME US	纳斯达克交易所	美国	2,665.00	3,731,700.53	0.25
84	CONOCOPHILLIPS	-	COP US	纽约证券交易所	美国	8,160.00	3,701,884.25	0.25
85	CHUBB LTD	-	CB US	纽约证券交易所	美国	3,370.00	3,659,534.53	0.25
86	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	-	PNC US	纽约证券交易所	美国	3,258.00	3,628,144.01	0.25
87	INTUITIVE SURGICAL INC	-	ISRG US	纳斯达克交易所	美国	859.00	3,542,499.36	0.24
88	DOMINION ENERGY INC	-	D US	纽约证券交易所	美国	6,121.00	3,536,523.34	0.24
89	INTUIT INC	-	INTU US	纳斯达克交易所	美国	1,935.00	3,535,779.19	0.24
90	STRYKER CORP	-	SYK US	纽约证券交易所	美国	2,394.00	3,506,212.73	0.24
91	SOUTHERN CO/THE	-	SO US	纽约证券交易所	美国	7,799.00	3,465,750.35	0.23
92	S&P GLOBAL INC	-	SPGI US	纽约证券交易所	美国	1,817.00	3,461,115.01	0.23
93	DUKE ENERGY CORP	-	DUK US	纽约证券交易所	美国	5,421.00	3,449,377.97	0.23
94	FISERV INC	-	FISV US	纳斯达克交易所	美国	4,247.00	3,425,876.55	0.23
95	TARGET CORP	-	TGT US	纽约证券交易所	美国	3,768.00	3,370,169.29	0.23
96	ZOETIS INC	-	ZTS US	纽约证券交易所	美国	3,542.00	3,270,328.85	0.22
97	BOSTON SCIENTIFIC CORP	-	BSX US	纽约证券交易所	美国	10,365.00	3,269,781.91	0.22
98	MORGAN STANLEY	-	MS US	纽约证券交易所	美国	9,148.00	3,262,390.35	0.22
99	ALLERGAN PLC	-	AGN US	纽约证券交易所	美国	2,441.00	3,255,415.62	0.22
100	RAYTHEON COMPANY	-	RTN US	纽约证券交易所	美国	2,071.00	3,174,739.84	0.21
101	MICRON TECHNOLOGY INC	-	MU US	纳斯达克交易所	美国	8,233.00	3,088,857.24	0.21
102	BLACKROCK INC	-	BLK US	纽约证券交易所	美国	877.00	3,075,582.64	0.21
103	CROWN CASTLE INTL CORP	-	CCI US	纽约证券交易所	美国	3,092.00	3,066,233.84	0.21
104	COLGATE-PALMOLIVE CO	-	CL US	纽约证券交易所	美国	6,373.00	3,060,579.77	0.21
105	APPLIED MATERIALS INC	-	AMAT US	纳斯达克交易所	美国	6,870.00	2,925,433.19	0.20
106	PROLOGIS INC	-	PLD US	纽约证券交易所	美国	4,698.00	2,921,491.08	0.20
107	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	-	VRTX US	纳斯达克交易所	美国	1,912.00	2,920,463.35	0.20
108	CSX CORP	-	CSX US	纳斯达克交易所	美国	5,783.00	2,919,245.86	0.20
109	MARSH & MCLENNAN COS	-	MMC US	纽约证券交易所	美国	3,753.00	2,916,900.81	0.20

110	SCHLUMBERGER LTD	-	SLB US	纽约证券交易所	美国	10,295.00	2,887,163.16	0.20
111	GLOBAL PAYMENTS INC	-	GPN US	纽约证券交易所	美国	2,235.00	2,846,440.29	0.19
112	DEERE & CO	-	DE US	纽约证券交易所	美国	2,341.00	2,829,558.30	0.19
113	SCHWAB (CHARLES) CORP	-	SCHW US	纽约证券交易所	美国	8,502.00	2,820,862.19	0.19
114	NORTHROP GRUMMAN CORP	-	NOC US	纽约证券交易所	美国	1,165.00	2,795,538.09	0.19
115	BIOGEN INC	-	BIIB US	纳斯达克交易所	美国	1,341.00	2,775,934.13	0.19
116	SERVICENOW INC	-	NOW US	纽约证券交易所	美国	1,402.00	2,761,268.14	0.19
117	ILLINOIS TOOL WORKS	-	ITW US	纽约证券交易所	美国	2,175.00	2,725,568.20	0.18
118	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	-	APD US	纽约证券交易所	美国	1,639.00	2,686,873.73	0.18
119	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	-	ICE US	纽约证券交易所	美国	4,141.00	2,673,625.51	0.18
120	ADVANCED MICRO DEVICES	-	AMD US	纳斯达克交易所	美国	8,282.00	2,649,648.10	0.18
121	NORFOLK SOUTHERN CORP	-	NSC US	纽约证券交易所	美国	1,939.00	2,625,967.74	0.18
122	EQUINIX INC	-	EQIX US	纳斯达克交易所	美国	634.00	2,581,653.03	0.17
123	PHILLIPS 66	-	PSX US	纽约证券交易所	美国	3,304.00	2,567,929.73	0.17
124	AON PLC	-	AON US	纽约证券交易所	美国	1,741.00	2,529,799.57	0.17
125	ILLUMINA INC	-	ILMN US	纳斯达克交易所	美国	1,093.00	2,529,513.05	0.17
126	EOG RESOURCES INC	-	EOG US	纽约证券交易所	美国	4,326.00	2,527,796.49	0.17
127	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	-	EW US	纽约证券交易所	美国	1,551.00	2,524,217.91	0.17
128	HUMANA INC	-	HUM US	纽约证券交易所	美国	984.00	2,516,006.15	0.17
129	ECOLAB INC	-	ECL US	纽约证券交易所	美国	1,865.00	2,510,918.20	0.17
130	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	-	COF US	纽约证券交易所	美国	3,463.00	2,486,159.53	0.17
131	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	-	SHW US	纽约证券交易所	美国	610.00	2,483,243.97	0.17
132	KIMBERLY-CLARK CORP	-	KMB US	纽约证券交易所	美国	2,549.00	2,445,960.01	0.17
133	AMERICAN ELECTRIC POWER	-	AEP US	纽约证券交易所	美国	3,673.00	2,421,684.79	0.16
134	EMERSON ELECTRIC CO	-	EMR US	纽约证券交易所	美国	4,530.00	2,409,982.70	0.16
135	GENERAL MOTORS CO	-	GM US	纽约证券交易所	美国	9,350.00	2,387,325.40	0.16
136	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	-	EL US	纽约证券交易所	美国	1,655.00	2,384,630.50	0.16
137	SIMON PROPERTY GROUP INC	-	SPG US	纽约证券交易所	美国	2,282.00	2,371,396.78	0.16
138	ACTIVISION BLIZZARD INC	-	ATVI US	纳斯达克交易所	美国	5,713.00	2,368,185.92	0.16

139	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	-	AIG US	纽约证券交易所	美国	6,469.00	2,316,473.51	0.16
140	WASTE MANAGEMENT INC	-	WM US	纽约证券交易所	美国	2,902.00	2,307,112.50	0.16
141	EXELON CORP	-	EXC US	纳斯达克交易所	美国	7,229.00	2,299,147.00	0.16
142	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	-	WBA US	纳斯达克交易所	美国	5,575.00	2,293,090.89	0.16
143	ANALOG DEVICES INC	-	ADI US	纳斯达克交易所	美国	2,739.00	2,270,772.35	0.15
144	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	-	LHX US	纽约证券交易所	美国	1,644.00	2,269,345.86	0.15
145	SYSCO CORP	-	SYU US	纽约证券交易所	美国	3,794.00	2,264,047.30	0.15
146	BAXTER INTERNATIONAL INC	-	BAX US	纽约证券交易所	美国	3,797.00	2,214,979.36	0.15
147	SEMPRA ENERGY	-	SRE US	纽约证券交易所	美国	2,096.00	2,214,958.01	0.15
148	LAM RESEARCH CORP	-	LRCX US	纳斯达克交易所	美国	1,078.00	2,198,948.47	0.15
149	PROGRESSIVE CORP	-	PGR US	纽约证券交易所	美国	4,347.00	2,195,265.94	0.15
150	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	-	BK US	纽约证券交易所	美国	6,241.00	2,191,290.90	0.15
151	ROSS STORES INC	-	ROST US	纳斯达克交易所	美国	2,690.00	2,184,735.16	0.15
152	GENERAL DYNAMICS CORP	-	GD US	纽约证券交易所	美国	1,742.00	2,143,100.50	0.15
153	KINDER MORGAN INC	-	KMI US	纽约证券交易所	美国	14,486.00	2,139,381.63	0.14
154	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	-	MAR US	纳斯达克交易所	美国	2,018.00	2,131,827.24	0.14
155	DOW INC	-	DOW US	纽约证券交易所	美国	5,514.00	2,105,286.15	0.14
156	AUTODESK INC	-	ADSK US	纳斯达克交易所	美国	1,636.00	2,093,840.57	0.14
157	METLIFE INC	-	MET US	纽约证券交易所	美国	5,813.00	2,066,968.60	0.14
158	DOLLAR GENERAL CORP	-	DG US	纽约证券交易所	美国	1,893.00	2,059,863.55	0.14
159	EATON CORP PLC	-	ETN US	纽约证券交易所	美国	3,074.00	2,031,255.13	0.14
160	MARATHON PETROLEUM CORP	-	MPC US	纽约证券交易所	美国	4,829.00	2,029,706.21	0.14
161	HCA HEALTHCARE INC	-	HCA US	纽约证券交易所	美国	1,967.00	2,028,276.22	0.14
162	AFLAC INC	-	AFL US	纽约证券交易所	美国	5,458.00	2,014,225.67	0.14
163	MOODY'S CORP	-	MCO US	纽约证券交易所	美国	1,207.00	1,999,057.11	0.14
164	VALERO ENERGY CORP	-	VLO US	纽约证券交易所	美国	3,054.00	1,995,242.73	0.14
165	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	-	PRU US	纽约证券交易所	美国	2,989.00	1,954,653.53	0.13
166	ROPER TECHNOLOGIES INC	-	ROP US	纽约证券交易所	美国	773.00	1,910,221.62	0.13
167	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	-	OXY US	纽约证券交易所	美国	6,643.00	1,909,790.77	0.13
168	ALLSTATE CORP	-	ALL US	纽约证券交易所	美国	2,409.00	1,889,797.12	0.13

169	FEDEX CORP	-	FDX US	纽约证券交易所	美国	1,785.00	1,882,945.10	0.13
170	FORD MOTOR CO	-	F US	纽约证券交易所	美国	28,960.00	1,878,885.99	0.13
171	NEWMONT CORP	-	NEM US	纽约证券交易所	美国	6,097.00	1,848,097.58	0.13
172	TRAVELERS COS INC/THE	-	TRV US	纽约证券交易所	美国	1,919.00	1,833,394.54	0.12
173	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	-	CTSH US	纳斯达克交易所	美国	4,072.00	1,761,807.50	0.12
174	DELTA AIR LINES INC	-	DAL US	纽约证券交易所	美国	4,280.00	1,746,103.79	0.12
175	XCEL ENERGY INC	-	XEL US	纳斯达克交易所	美国	3,899.00	1,726,940.94	0.12
176	WELLTOWER INC	-	WELL US	纽约证券交易所	美国	3,017.00	1,721,239.64	0.12
177	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	-	ORLY US	纳斯达克交易所	美国	562.00	1,718,252.85	0.12
178	VF CORP	-	VFC US	纽约证券交易所	美国	2,435.00	1,692,929.10	0.11
179	GENERAL MILLS INC	-	GIS US	纽约证券交易所	美国	4,494.00	1,679,161.85	0.11
180	AMPHENOL CORP-CL A	-	APH US	纽约证券交易所	美国	2,205.00	1,664,850.25	0.11
181	TE CONNECTIVITY LTD	-	TEL US	纽约证券交易所	美国	2,487.00	1,662,805.73	0.11
182	PUBLIC STORAGE	-	PSA US	纽约证券交易所	美国	1,117.00	1,659,472.78	0.11
183	TRANE TECHNOLOGIES PLC	-	TT US	纽约证券交易所	美国	1,781.00	1,651,479.45	0.11
184	CONSTELLATION BRANDS INC-A	-	STZ US	纽约证券交易所	美国	1,245.00	1,648,048.77	0.11
185	PPG INDUSTRIES INC	-	PPG US	纽约证券交易所	美国	1,758.00	1,637,142.67	0.11
186	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	-	JCI US	纽约证券交易所	美国	5,737.00	1,629,314.32	0.11
187	ELECTRONIC ARTS INC	-	EA US	纳斯达克交易所	美国	2,171.00	1,628,274.45	0.11
188	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	-	HLT US	纽约证券交易所	美国	2,098.00	1,623,286.26	0.11
189	ONEOK INC	-	OKE US	纽约证券交易所	美国	3,072.00	1,621,675.17	0.11
190	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	-	ZBH US	纽约证券交易所	美国	1,529.00	1,596,578.15	0.11
191	YUM! BRANDS INC	-	YUM US	纽约证券交易所	美国	2,249.00	1,580,400.70	0.11
192	HP INC	-	HPQ US	纽约证券交易所	美国	11,021.00	1,579,980.59	0.11
193	IHS MARKIT LTD	-	INFO US	纽约证券交易所	美国	2,982.00	1,567,508.19	0.11
194	CONSOLIDATED EDISON INC	-	ED US	纽约证券交易所	美国	2,472.00	1,560,170.20	0.11
195	REGENERON PHARMACEUTICALS	-	REGN US	纳斯达克交易所	美国	594.00	1,555,937.60	0.11
196	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	-	PEG US	纽约证券交易所	美国	3,761.00	1,549,323.68	0.10
197	AVALONBAY COMMUNITIES INC	-	AVB US	纽约证券交易所	美国	1,038.00	1,518,499.69	0.10
198	WEC ENERGY GROUP INC	-	WEC US	纽约证券交易所	美国	2,345.00	1,508,808.00	0.10

199	STATE STREET CORP	-	STT US	纽约证券交易所	美国	2,704.00	1,492,114.30	0.10
200	WILLIAMS COS INC	-	WMB US	纽约证券交易所	美国	9,014.00	1,491,595.83	0.10
201	T ROWE PRICE GROUP INC	-	TROW US	纳斯达克交易所	美国	1,737.00	1,476,415.62	0.10
202	AUTOZONE INC	-	AZO US	纽约证券交易所	美国	177.00	1,471,014.58	0.10
203	EQUITY RESIDENTIAL	-	EQR US	纽约证券交易所	美国	2,596.00	1,465,478.61	0.10
204	KLA CORP	-	KLAC US	纳斯达克交易所	美国	1,173.00	1,457,979.83	0.10
205	IQVIA HOLDINGS INC	-	IQV US	纽约证券交易所	美国	1,342.00	1,446,531.95	0.10
206	TRANSDIGM GROUP INC	-	TDG US	纽约证券交易所	美国	370.00	1,445,468.64	0.10
207	EBAY INC	-	EBAY US	纳斯达克交易所	美国	5,687.00	1,432,615.48	0.10
208	MOTOROLA SOLUTIONS INC	-	MSI US	纽约证券交易所	美国	1,274.00	1,432,160.56	0.10
209	EVERSOURCE ENERGY	-	ES US	纽约证券交易所	美国	2,407.00	1,428,471.06	0.10
210	CUMMINS INC	-	CMI US	纽约证券交易所	美国	1,139.00	1,421,996.80	0.10
211	PACCAR INC	-	PCAR US	纳斯达克交易所	美国	2,572.00	1,419,274.40	0.10
212	SBA COMMUNICATIONS CORP	-	SBAC US	纳斯达克交易所	美国	837.00	1,407,159.74	0.10
213	PAYCHEX INC	-	PAYX US	纳斯达克交易所	美国	2,369.00	1,405,754.11	0.10
214	EDISON INTERNATIONAL	-	EIX US	纽约证券交易所	美国	2,666.00	1,402,516.60	0.09
215	TYSON FOODS INC-CL A	-	TSN US	纽约证券交易所	美国	2,195.00	1,394,073.58	0.09
216	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	-	DFS US	纽约证券交易所	美国	2,331.00	1,379,302.31	0.09
217	PARKER HANNIFIN CORP	-	PH US	纽约证券交易所	美国	955.00	1,371,228.62	0.09
218	AGILENT TECHNOLOGIES INC	-	A US	纽约证券交易所	美国	2,301.00	1,369,416.27	0.09
219	FIRSTENERGY CORP	-	FE US	纽约证券交易所	美国	4,018.00	1,362,276.06	0.09
220	CENTENE CORP	-	CNC US	纽约证券交易所	美国	3,077.00	1,349,552.80	0.09
221	WILLIS TOWERS WATSON PLC	-	WLTW US	纳斯达克交易所	美国	956.00	1,346,787.78	0.09
222	PPL CORP	-	PPL US	纽约证券交易所	美国	5,377.00	1,345,895.66	0.09
223	ARCHER-DANIELS-MID LAND CO	-	ADM US	纽约证券交易所	美国	4,140.00	1,338,656.04	0.09
224	SOUTHWEST AIRLINES CO	-	LUV US	纽约证券交易所	美国	3,522.00	1,326,298.12	0.09
225	STANLEY BLACK & DECKER INC	-	SWK US	纽约证券交易所	美国	1,130.00	1,306,545.99	0.09
226	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	-	PXD US	纽约证券交易所	美国	1,231.00	1,299,920.48	0.09
227	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	-	MCHP US	纳斯达克交易所	美国	1,777.00	1,298,183.20	0.09

228	DIGITAL REALTY TRUST INC	-	DLR US	纽约证券交易所	美国	1,552.00	1,296,432.45	0.09
229	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	-	FLT US	纽约证券交易所	美国	645.00	1,294,639.01	0.09
230	DTE ENERGY COMPANY	-	DTE US	纽约证券交易所	美国	1,428.00	1,293,766.71	0.09
231	MCKESSON CORP	-	MCK US	纽约证券交易所	美国	1,340.00	1,293,030.30	0.09
232	TWITTER INC	-	TWTR US	纽约证券交易所	美国	5,773.00	1,290,768.96	0.09
233	T-MOBILE US INC	-	TMUS US	纳斯达克交易所	美国	2,354.00	1,287,811.26	0.09
234	XILINX INC	-	XLNX US	纳斯达克交易所	美国	1,870.00	1,275,457.95	0.09
235	VERISK ANALYTICS INC	-	VRSK US	纳斯达克交易所	美国	1,218.00	1,268,943.71	0.09
236	MONSTER BEVERAGE CORP	-	MNST US	纳斯达克交易所	美国	2,839.00	1,258,635.19	0.09
237	LYONDELLBASELL INDU-CL A	-	LYB US	纽约证券交易所	美国	1,909.00	1,258,243.62	0.09
238	APTIV PLC	-	APTIV US	纽约证券交易所	美国	1,898.00	1,257,481.40	0.09
239	REALTY INCOME CORP	-	O US	纽约证券交易所	美国	2,423.00	1,244,592.38	0.08
240	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	-	ALXN US	纳斯达克交易所	美国	1,645.00	1,241,113.07	0.08
241	ENTERGY CORP	-	ETR US	纽约证券交易所	美国	1,480.00	1,236,908.16	0.08
242	ROCKWELL AUTOMATION INC	-	ROK US	纽约证券交易所	美国	859.00	1,214,511.28	0.08
243	LAS VEGAS SANDS CORP	-	LVS US	纽约证券交易所	美国	2,513.00	1,210,353.40	0.08
244	KROGER CO	-	KR US	纽约证券交易所	美国	5,964.00	1,206,159.59	0.08
245	CERNER CORP	-	CERN US	纳斯达克交易所	美国	2,335.00	1,195,481.05	0.08
246	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	-	RCL US	纽约证券交易所	美国	1,278.00	1,190,319.57	0.08
247	AMETEK INC	-	AME US	纽约证券交易所	美国	1,700.00	1,182,870.52	0.08
248	VIACOMCBS INC - CLASS B	-	VIAC US	纳斯达克交易所	美国	4,018.00	1,176,434.70	0.08
249	FORTIVE CORP	-	FTV US	纽约证券交易所	美国	2,197.00	1,170,807.48	0.08
250	CINTAS CORP	-	CTAS US	纳斯达克交易所	美国	623.00	1,169,468.12	0.08
251	WEYERHAEUSER CO	-	WY US	纽约证券交易所	美国	5,541.00	1,167,384.75	0.08
252	NORTHERN TRUST CORP	-	NTRS US	纳斯达克交易所	美国	1,575.00	1,167,313.59	0.08
253	M & T BANK CORP	-	MTB US	纽约证券交易所	美国	981.00	1,161,709.96	0.08
254	CORNING INC	-	GLW US	纽约证券交易所	美国	5,719.00	1,161,398.40	0.08
255	IDEXX LABORATORIES INC	-	IDXX US	纳斯达克交易所	美国	637.00	1,160,419.78	0.08
256	RESMED INC	-	RMD US	纽约证券交易所	美国	1,069.00	1,155,697.73	0.08
257	DOLLAR TREE INC	-	DLTR US	纳斯达克交易所	美国	1,760.00	1,154,756.43	0.08
258	AMERICAN WATER WORKS CO INC	-	AWK US	纽约证券交易所	美国	1,344.00	1,151,843.17	0.08

259	CORTEVA INC	-	CTVA US	纽约证券交易所	美国	5,565.00	1,147,594.67	0.08
260	ANSYS INC	-	ANSS US	纳斯达克交易所	美国	636.00	1,142,092.96	0.08
261	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	-	HIG US	纽约证券交易所	美国	2,680.00	1,136,169.05	0.08
262	MSCI INC	-	MSCI US	纽约证券交易所	美国	629.00	1,132,901.53	0.08
263	FIFTH THIRD BANCORP	-	FITB US	纳斯达克交易所	美国	5,277.00	1,131,644.14	0.08
264	HERSHEY CO/THE	-	HSY US	纽约证券交易所	美国	1,102.00	1,129,948.79	0.08
265	VENTAS INC	-	VTR US	纽约证券交易所	美国	2,772.00	1,116,577.64	0.08
266	HALLIBURTON CO	-	HAL US	纽约证券交易所	美国	6,528.00	1,114,379.30	0.08
267	SYNCHRONY FINANCIAL	-	SYF US	纽约证券交易所	美国	4,421.00	1,110,612.51	0.08
268	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	-	CMG US	纽约证券交易所	美国	190.00	1,109,570.89	0.08
269	FASTENAL CO	-	FAST US	纳斯达克交易所	美国	4,265.00	1,099,391.57	0.07
270	BALL CORP	-	BLL US	纽约证券交易所	美国	2,432.00	1,097,198.88	0.07
271	AMERIPRISE FINANCIAL INC	-	AMP US	纽约证券交易所	美国	942.00	1,094,693.86	0.07
272	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	-	MKC US	纽约证券交易所	美国	918.00	1,086,976.65	0.07
273	SYNOPSYS INC	-	SNPS US	纳斯达克交易所	美国	1,118.00	1,085,675.31	0.07
274	SKYWORKS SOLUTIONS INC	-	SWKS US	纳斯达克交易所	美国	1,267.00	1,068,439.63	0.07
275	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	-	HPE US	纽约证券交易所	美国	9,623.00	1,064,713.09	0.07
276	CDW CORP/DE	-	CDW US	纳斯达克交易所	美国	1,068.00	1,064,241.08	0.07
277	CBRE GROUP INC - A	-	CBRE US	纽约证券交易所	美国	2,489.00	1,064,224.96	0.07
278	CARNIVAL CORP	-	CCL US	纽约证券交易所	美国	2,979.00	1,056,354.13	0.07
279	KRAFT HEINZ CO/THE	-	KHC US	纳斯达克交易所	美国	4,631.00	1,038,016.91	0.07
280	ALIGN TECHNOLOGY INC	-	ALGN US	纳斯达克交易所	美国	533.00	1,037,558.51	0.07
281	BEST BUY CO INC	-	BBY US	纽约证券交易所	美国	1,693.00	1,036,980.04	0.07
282	KEYCORP	-	KEY US	纽约证券交易所	美国	7,325.00	1,034,277.46	0.07
283	VERISIGN INC	-	VRSN US	纳斯达克交易所	美国	768.00	1,032,325.80	0.07
284	ESSEX PROPERTY TRUST INC	-	ESS US	纽约证券交易所	美国	491.00	1,030,540.03	0.07
285	BOSTON PROPERTIES INC	-	BXP US	纽约证券交易所	美国	1,069.00	1,028,098.92	0.07
286	FIRST REPUBLIC BANK/CA	-	FRC US	纽约证券交易所	美国	1,253.00	1,026,651.43	0.07
287	CADENCE DESIGN SYS INC	-	CDNS US	纳斯达克交易所	美国	2,086.00	1,009,351.22	0.07
288	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	-	MTD US	纽约证券交易所	美国	181.00	1,001,668.47	0.07

289	CLOROX COMPANY	-	CLX US	纽约证券交易所	美国	933.00	999,360.32	0.07
290	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	-	KEYS US	纽约证券交易所	美国	1,395.00	998,774.53	0.07
291	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	-	UAL US	纳斯达克交易所	美国	1,618.00	994,315.14	0.07
292	VULCAN MATERIALS CO	-	VMC US	纽约证券交易所	美国	984.00	988,430.99	0.07
293	FREEPORT-MCMORAN INC	-	FCX US	纽约证券交易所	美国	10,790.00	987,584.36	0.07
294	AMEREN CORPORATION	-	AEE US	纽约证券交易所	美国	1,829.00	979,927.28	0.07
295	REPUBLIC SERVICES INC	-	RSG US	纽约证券交易所	美国	1,566.00	979,183.48	0.07
296	WESTERN DIGITAL CORP	-	WDC US	纳斯达克交易所	美国	2,211.00	978,985.28	0.07
297	COPART INC	-	CPRT US	纳斯达克交易所	美国	1,521.00	964,946.17	0.07
298	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	-	ARE US	纽约证券交易所	美国	856.00	964,895.52	0.07
299	INTERNATIONAL PAPER CO	-	IP US	纽约证券交易所	美国	2,916.00	936,776.69	0.06
300	CMS ENERGY CORP	-	CMS US	纽约证券交易所	美国	2,110.00	924,991.10	0.06
301	ARTHUR J GALLAGHER & CO	-	AJG US	纽约证券交易所	美国	1,387.00	921,444.47	0.06
302	DR HORTON INC	-	DHI US	纽约证券交易所	美国	2,493.00	917,410.41	0.06
303	CITIZENS FINANCIAL GROUP	-	CFG US	纽约证券交易所	美国	3,233.00	915,920.16	0.06
304	OMNICOM GROUP	-	OMC US	纽约证券交易所	美国	1,619.00	915,077.78	0.06
305	CONCHO RESOURCES INC	-	CXO US	纽约证券交易所	美国	1,495.00	913,304.22	0.06
306	AMCOR PLC	-	AMCR US	纽约证券交易所	美国	12,049.00	911,169.57	0.06
307	MARTIN MARIETTA MATERIALS	-	MLM US	纽约证券交易所	美国	464.00	905,182.60	0.06
308	TELEFLEX INC	-	TFX US	纽约证券交易所	美国	344.00	903,385.53	0.06
309	HESS CORP	-	HES US	纽约证券交易所	美国	1,926.00	897,669.93	0.06
310	CHURCH & DWIGHT CO INC	-	CHD US	纽约证券交易所	美国	1,825.00	895,538.28	0.06
311	KELLOGG CO	-	K US	纽约证券交易所	美国	1,851.00	893,059.36	0.06
312	MGM RESORTS INTERNATIONAL	-	MGM US	纽约证券交易所	美国	3,829.00	888,703.91	0.06
313	NUCOR CORP	-	NUE US	纽约证券交易所	美国	2,255.00	885,359.31	0.06
314	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	-	PEAK US	纽约证券交易所	美国	3,681.00	885,168.65	0.06
315	EQUIFAX INC	-	EFX US	纽约证券交易所	美国	900.00	879,754.63	0.06
316	DOVER CORP	-	DOV US	纽约证券交易所	美国	1,080.00	868,402.96	0.06
317	CONAGRA BRANDS INC	-	CAG US	纽约证券交易所	美国	3,619.00	864,452.75	0.06

318	BAKER HUGHES CO	-	BKR US	纽约证券交易所	美国	4,833.00	864,140.43	0.06
319	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	-	MXIM US	纳斯达克交易所	美国	2,012.00	863,361.40	0.06
320	WELLCARE HEALTH PLANS INC	-	WCG US	纽约证券交易所	美国	374.00	861,550.51	0.06
321	REGIONS FINANCIAL CORP	-	RF US	纽约证券交易所	美国	7,174.00	858,810.96	0.06
322	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	-	LH US	纽约证券交易所	美国	722.00	852,078.23	0.06
323	CINCINNATI FINANCIAL CORP	-	CINF US	纳斯达克交易所	美国	1,129.00	828,175.05	0.06
324	COOPER COS INC/THE	-	COO US	纽约证券交易所	美国	368.00	824,829.05	0.06
325	DUPONT DE NEMOURS INC	-	DD US	纽约证券交易所	美国	1,812.00	811,544.14	0.05
326	LENNAR CORP-A	-	LEN US	纽约证券交易所	美国	2,081.00	809,929.77	0.05
327	INCYTE CORP	-	INCY US	纳斯达克交易所	美国	1,329.00	809,576.01	0.05
328	HUNTINGTON BANCSHARES INC	-	HBAN US	纳斯达克交易所	美国	7,680.00	807,944.42	0.05
329	GENUINE PARTS CO	-	GPC US	纽约证券交易所	美国	1,080.00	800,368.26	0.05
330	KANSAS CITY SOUTHERN	-	KSU US	纽约证券交易所	美国	737.00	787,465.92	0.05
331	FORTINET INC	-	FTNT US	纳斯达克交易所	美国	1,055.00	785,741.96	0.05
332	EXPEDIA GROUP INC	-	EXPE US	纳斯达克交易所	美国	1,039.00	783,828.11	0.05
333	WATERS CORP	-	WAT US	纽约证券交易所	美国	479.00	780,764.79	0.05
334	MID-AMERICA APARTMENT COMM	-	MAA US	纽约证券交易所	美国	848.00	780,059.71	0.05
335	DIAMONDBACK ENERGY INC	-	FANG US	纳斯达克交易所	美国	1,198.00	776,076.30	0.05
336	CELANESE CORP	-	CE US	纽约证券交易所	美国	898.00	771,300.95	0.05
337	EVERGY INC	-	EVRG US	纽约证券交易所	美国	1,694.00	769,212.97	0.05
338	CARDINAL HEALTH INC	-	CAH US	纽约证券交易所	美国	2,175.00	767,462.23	0.05
339	WW GRAINGER INC	-	GWW US	纽约证券交易所	美国	324.00	765,152.96	0.05
340	NORTONLIFELOCK INC	-	NLOK US	纳斯达克交易所	美国	4,264.00	759,131.11	0.05
341	ULTA BEAUTY INC	-	ULTA US	纳斯达克交易所	美国	425.00	750,530.99	0.05
342	TIFFANY & CO	-	TIF US	纽约证券交易所	美国	802.00	747,760.04	0.05
343	CARMAX INC	-	KMX US	纽约证券交易所	美国	1,222.00	747,379.42	0.05
344	MARKETAXESS HOLDINGS INC	-	MKTX US	纳斯达克交易所	美国	282.00	745,818.71	0.05
345	QUEST DIAGNOSTICS INC	-	DGX US	纽约证券交易所	美国	1,001.00	745,733.39	0.05
346	NETAPP INC	-	NTAP US	纳斯达克交易所	美国	1,697.00	736,953.56	0.05
347	PRINCIPAL FINANCIAL	-	PFJ US	纳斯达克交易所	美国	1,920.00	736,686.72	0.05

	GROUP							
348	XYLEM INC	-	XYL US	纽约证券交易所	美国	1,339.00	735,987.77	0.05
349	WABTEC CORP	-	WAB US	纽约证券交易所	美国	1,354.00	734,881.28	0.05
350	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	-	BR US	纽约证券交易所	美国	852.00	734,287.47	0.05
351	GARMIN LTD	-	GRMN US	纳斯达克交易所	美国	1,074.00	730,962.33	0.05
352	HOLOGIC INC	-	HOLX US	纳斯达克交易所	美国	1,994.00	726,269.44	0.05
353	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	-	AKAM US	纳斯达克交易所	美国	1,201.00	723,727.59	0.05
354	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	-	TTWO US	纳斯达克交易所	美国	841.00	718,294.88	0.05
355	GARTNER INC	-	IT US	纽约证券交易所	美国	665.00	714,896.56	0.05
356	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	-	IFF US	纽约证券交易所	美国	794.00	714,655.04	0.05
357	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	-	ZBRA US	纳斯达克交易所	美国	401.00	714,582.21	0.05
358	SEAGATE TECHNOLOGY	-	STX US	纳斯达克交易所	美国	1,719.00	713,529.22	0.05
359	CENTERPOINT ENERGY INC	-	CNP US	纽约证券交易所	美国	3,735.00	710,550.04	0.05
360	UDR INC	-	UDR US	纽约证券交易所	美国	2,179.00	709,893.23	0.05
361	EXTRA SPACE STORAGE INC	-	EXR US	纽约证券交易所	美国	963.00	709,563.67	0.05
362	MASCO CORP	-	MAS US	纽约证券交易所	美国	2,112.00	707,071.91	0.05
363	CITRIX SYSTEMS INC	-	CTXS US	纳斯达克交易所	美国	910.00	704,031.13	0.05
364	QORVO INC	-	QRVO US	纳斯达克交易所	美国	863.00	699,758.14	0.05
365	HASBRO INC	-	HAS US	纳斯达克交易所	美国	946.00	696,971.63	0.05
366	LOEWS CORP	-	L US	纽约证券交易所	美国	1,902.00	696,475.76	0.05
367	WYNN RESORTS LTD	-	WYNN US	纳斯达克交易所	美国	718.00	695,587.55	0.05
368	DARDEN RESTAURANTS INC	-	DRI US	纽约证券交易所	美国	911.00	692,793.24	0.05
369	ATMOS ENERGY CORP	-	ATO US	纽约证券交易所	美国	887.00	692,177.31	0.05
370	HOST HOTELS & RESORTS INC	-	HST US	纽约证券交易所	美国	5,333.00	690,135.58	0.05
371	CBOE GLOBAL MARKETS INC	-	CBOE US	BZX 交易所	美国	824.00	689,806.66	0.05
372	EXPEDITORS INTL WASH INC	-	EXPD US	纳斯达克交易所	美国	1,266.00	689,062.43	0.05
373	AES CORP	-	AES US	纽约证券交易所	美国	4,937.00	685,385.84	0.05
374	ALLIANT ENERGY CORP	-	LNT US	纳斯达克交易所	美国	1,787.00	682,165.21	0.05
375	FOX CORP - CLASS A	-	FOXA US	纳斯达克交易所	美国	2,636.00	681,689.99	0.05
376	IDEX CORP	-	IEX US	纽约证券交易所	美国	565.00	677,947.12	0.05
377	LEIDOS HOLDINGS INC	-	LDOS US	纽约证券交易所	美国	989.00	675,388.32	0.05

378	CENTURYLINK INC	-	CTL US	纽约证券交易所	美国	7,297.00	672,459.43	0.05
379	SVB FINANCIAL GROUP	-	SIVB US	纳斯达克交易所	美国	383.00	670,749.91	0.05
380	FMC CORP	-	FMC US	纽约证券交易所	美国	963.00	670,598.81	0.05
381	STERIS PLC	-	STE US	纽约证券交易所	美国	630.00	669,886.81	0.05
382	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	-	VAR US	纽约证券交易所	美国	676.00	669,706.55	0.05
383	AMERISOURCEBERGEN CORP	-	ABC US	纽约证券交易所	美国	1,117.00	662,511.16	0.04
384	DUKE REALTY CORP	-	DRE US	纽约证券交易所	美国	2,733.00	661,016.65	0.04
385	DENTSPLY SIRONA INC	-	XRAY US	纳斯达克交易所	美国	1,654.00	652,971.34	0.04
386	LAMB WESTON HOLDINGS INC	-	LW US	纽约证券交易所	美国	1,086.00	651,776.46	0.04
387	HORMEL FOODS CORP	-	HRL US	纽约证券交易所	美国	2,067.00	650,477.42	0.04
388	UNITED RENTALS INC	-	URI US	纽约证券交易所	美国	558.00	649,188.85	0.04
389	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	-	NCLH US	纽约证券交易所	美国	1,582.00	644,633.11	0.04
390	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	-	BF/B US	纽约证券交易所	美国	1,355.00	639,005.97	0.04
391	NASDAQ INC	-	NDAQ US	纳斯达克交易所	美国	853.00	637,319.82	0.04
392	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	-	J US	纽约证券交易所	美国	1,007.00	631,058.75	0.04
393	OLD DOMINION FREIGHT LINE	-	ODFL US	纳斯达克交易所	美国	474.00	627,549.09	0.04
394	ARCONIC INC	-	ARNC US	纽约证券交易所	美国	2,880.00	618,214.10	0.04
395	JM SMUCKER CO/THE	-	SJM US	纽约证券交易所	美国	848.00	616,014.09	0.04
396	NOBLE ENERGY INC	-	NBL US	纳斯达克交易所	美国	3,505.00	607,377.27	0.04
397	LINCOLN NATIONAL CORP	-	LNC US	纽约证券交易所	美国	1,475.00	607,206.70	0.04
398	ALLEGION PLC	-	ALLE US	纽约证券交易所	美国	691.00	600,351.82	0.04
399	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	-	UHS US	纽约证券交易所	美国	597.00	597,480.97	0.04
400	EVEREST RE GROUP LTD	-	RE US	纽约证券交易所	美国	303.00	585,181.24	0.04
401	WESTERN UNION CO	-	WU US	纽约证券交易所	美国	3,118.00	582,512.98	0.04
402	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	-	JKHY US	纳斯达克交易所	美国	572.00	581,279.59	0.04
403	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	-	AAL US	纳斯达克交易所	美国	2,899.00	580,024.43	0.04
404	ADVANCE AUTO PARTS INC	-	AAP US	纽约证券交易所	美国	515.00	575,413.72	0.04
405	WESTROCK CO	-	WRK US	纽约证券交易所	美国	1,917.00	573,851.54	0.04
406	TRACTOR SUPPLY COMPANY	-	TSCO US	纳斯达克交易所	美国	880.00	573,633.39	0.04

407	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	-	RJF US	纽约证券交易所	美国	918.00	572,915.40	0.04
408	ARISTA NETWORKS INC	-	ANET US	纽约证券交易所	美国	403.00	571,840.51	0.04
409	LKQ CORP	-	LKQ US	纳斯达克交易所	美国	2,279.00	567,585.72	0.04
410	AVERY DENNISON CORP	-	AVY US	纽约证券交易所	美国	621.00	566,741.05	0.04
411	MARATHON OIL CORP	-	MRO US	纽约证券交易所	美国	5,949.00	563,589.20	0.04
412	PERKINELMER INC	-	PKI US	纽约证券交易所	美国	826.00	559,523.33	0.04
413	EASTMAN CHEMICAL CO	-	EMN US	纽约证券交易所	美国	1,011.00	559,015.88	0.04
414	PACKAGING CORP OF AMERICA	-	PKG US	纽约证券交易所	美国	703.00	549,229.04	0.04
415	REGENCY CENTERS CORP	-	REG US	纳斯达克交易所	美国	1,246.00	548,400.06	0.04
416	C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	-	CHRW US	纳斯达克交易所	美国	1,005.00	548,266.53	0.04
417	VORNADO REALTY TRUST	-	VNO US	纽约证券交易所	美国	1,178.00	546,494.58	0.04
418	GLOBE LIFE INC	-	GL US	纽约证券交易所	美国	740.00	543,341.34	0.04
419	NISOURCE INC	-	NI US	纽约证券交易所	美国	2,778.00	539,535.96	0.04
420	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	-	CF US	纽约证券交易所	美国	1,617.00	538,531.81	0.04
421	MYLAN NV	-	MYL US	纳斯达克交易所	美国	3,838.00	538,170.58	0.04
422	COMERICA INC	-	CMA US	纽约证券交易所	美国	1,072.00	536,581.40	0.04
423	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	-	HII US	纽约证券交易所	美国	304.00	532,057.47	0.04
424	E*TRADE FINANCIAL CORP	-	ETFC US	纳斯达克交易所	美国	1,680.00	531,737.13	0.04
425	NVR INC	-	NVR US	纽约证券交易所	美国	20.00	531,364.60	0.04
426	DISCOVERY INC-C	-	DISCK US	纳斯达克交易所	美国	2,494.00	530,484.62	0.04
427	TEXTRON INC	-	TXT US	纽约证券交易所	美国	1,697.00	528,002.07	0.04
428	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	-	TAP US	纽约证券交易所	美国	1,397.00	525,296.00	0.04
429	PINNACLE WEST CAPITAL	-	PNW US	纽约证券交易所	美国	836.00	524,481.04	0.04
430	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	-	LYV US	纽约证券交易所	美国	1,048.00	522,521.29	0.04
431	DEVON ENERGY CORP	-	DVN US	纽约证券交易所	美国	2,878.00	521,412.77	0.04
432	WR BERKLEY CORP	-	WRB US	纽约证券交易所	美国	1,079.00	520,137.80	0.04
433	NRG ENERGY INC	-	NRG US	纽约证券交易所	美国	1,871.00	518,835.69	0.04
434	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	-	JBHT US	纳斯达克交易所	美国	634.00	516,507.52	0.03
435	PULTEGROUP INC	-	PHM US	纽约证券交易所	美国	1,894.00	512,661.40	0.03
436	HENRY SCHEIN INC	-	HSIC US	纳斯达克交易所	美国	1,091.00	507,808.20	0.03

437	NATIONAL OILWELL VARCO INC	-	NOV US	纽约证券交易所	美国	2,869.00	501,368.68	0.03
438	APACHE CORP	-	APA US	纽约证券交易所	美国	2,796.00	499,144.60	0.03
439	DXC TECHNOLOGY CO	-	DXC US	纽约证券交易所	美国	1,903.00	499,033.89	0.03
440	WHIRLPOOL CORP	-	WHR US	纽约证券交易所	美国	470.00	483,723.43	0.03
441	SNAP-ON INC	-	SNA US	纽约证券交易所	美国	407.00	480,979.69	0.03
442	IRON MOUNTAIN INC	-	IRM US	纽约证券交易所	美国	2,135.00	474,677.74	0.03
443	FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	-	FBHS US	纽约证券交易所	美国	1,034.00	471,322.95	0.03
444	DISH NETWORK CORP-A	-	DISH US	纳斯达克交易所	美国	1,903.00	470,889.38	0.03
445	FEDERAL REALTY INVS TRUST	-	FRT US	纽约证券交易所	美国	522.00	468,780.13	0.03
446	TECHNIPFMC PLC	-	FTI US	纽约证券交易所	美国	3,125.00	467,405.40	0.03
447	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	-	IPG US	纽约证券交易所	美国	2,883.00	464,596.08	0.03
448	BORGWARNER INC	-	BWA US	纽约证券交易所	美国	1,535.00	464,533.30	0.03
449	ZIONS BANCORP NA	-	ZION US	纳斯达克交易所	美国	1,267.00	458,912.85	0.03
450	KIMCO REALTY CORP	-	KIM US	纽约证券交易所	美国	3,140.00	453,658.10	0.03
451	F5 NETWORKS INC	-	FFIV US	纳斯达克交易所	美国	452.00	440,350.30	0.03
452	CAMPBELL SOUP CO	-	CPB US	纽约证券交易所	美国	1,256.00	433,023.34	0.03
453	ALASKA AIR GROUP INC	-	ALK US	纽约证券交易所	美国	916.00	432,936.00	0.03
454	JUNIPER NETWORKS INC	-	JNPR US	纽约证券交易所	美国	2,489.00	427,669.45	0.03
455	MOHAWK INDUSTRIES INC	-	MHK US	纽约证券交易所	美国	442.00	420,525.06	0.03
456	KOHL'S CORP	-	KSS US	纽约证券交易所	美国	1,164.00	413,729.12	0.03
457	ASSURANT INC	-	AIZ US	纽约证券交易所	美国	450.00	411,498.13	0.03
458	PVH CORP	-	PVH US	纽约证券交易所	美国	551.00	404,184.63	0.03
459	ALBEMARLE CORP	-	ALB US	纽约证券交易所	美国	788.00	401,518.82	0.03
460	PENTAIR PLC	-	PNR US	纽约证券交易所	美国	1,250.00	399,997.87	0.03
461	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	-	AIV US	纽约证券交易所	美国	1,107.00	398,875.05	0.03
462	ABIOMED INC	-	ABMD US	纳斯达克交易所	美国	335.00	398,673.44	0.03
463	MOSAIC CO/THE	-	MOS US	纽约证券交易所	美国	2,600.00	392,508.92	0.03
464	HOLLYFRONTIER CORP	-	HFC US	纽约证券交易所	美国	1,104.00	390,554.46	0.03
465	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	-	PBCT US	纳斯达克交易所	美国	3,302.00	389,298.47	0.03
466	SL GREEN REALTY CORP	-	SLG US	纽约证券交易所	美国	606.00	388,429.79	0.03
467	TAPESTRY INC	-	TPR US	纽约证券交易所	美国	2,052.00	386,079.93	0.03
468	ROBERT HALF INTL INC	-	RHI US	纽约证券交易所	美国	874.00	385,038.10	0.03
469	NEWELL BRANDS INC	-	NWL US	纳斯达克交易所	美国	2,833.00	379,855.90	0.03
470	FRANKLIN RESOURCES	-	BEN US	纽约证券交易所	美国	2,074.00	375,895.24	0.03

	INC							
471	NIELSEN HOLDINGS PLC	-	NLSN US	纽约证券交易所	美国	2,646.00	374,718.21	0.03
472	CABOT OIL & GAS CORP	-	COG US	纽约证券交易所	美国	3,033.00	368,374.96	0.02
473	PERRIGO CO PLC	-	PRGO US	纽约证券交易所	美国	1,012.00	364,715.18	0.02
474	FLIR SYSTEMS INC	-	FLIR US	纳斯达克交易所	美国	997.00	362,160.98	0.02
475	XEROX HOLDINGS CORP	-	XRX US	纽约证券交易所	美国	1,382.00	355,467.67	0.02
476	DAVITA INC	-	DVA US	纽约证券交易所	美国	666.00	348,600.57	0.02
477	INVESCO LTD	-	IVZ US	纽约证券交易所	美国	2,768.00	347,195.99	0.02
478	LEGGETT & PLATT INC	-	LEG US	纽约证券交易所	美国	978.00	346,799.04	0.02
479	SMITH (A. O.) CORP	-	AOS US	纽约证券交易所	美国	1,019.00	338,660.75	0.02
480	FLOWERVE CORP	-	FLS US	纽约证券交易所	美国	973.00	337,830.93	0.02
481	SEALED AIR CORP	-	SEE US	纽约证券交易所	美国	1,149.00	319,263.49	0.02
482	UNUM GROUP	-	UNM US	纽约证券交易所	美国	1,534.00	312,055.47	0.02
483	FOX CORP - CLASS B	-	FOX US	纳斯达克交易所	美国	1,207.00	306,497.95	0.02
484	RALPH LAUREN CORP	-	RL US	纽约证券交易所	美国	369.00	301,749.81	0.02
485	QUANTA SERVICES INC	-	PWR US	纽约证券交易所	美国	1,058.00	300,473.17	0.02
486	CAPRI HOLDINGS LTD	-	CPRI US	纽约证券交易所	美国	1,127.00	299,942.07	0.02
487	HARLEY-DAVIDSON INC	-	HOG US	纽约证券交易所	美国	1,147.00	297,583.28	0.02
488	NEWS CORP - CLASS A	-	NWSA US	纳斯达克交易所	美国	2,889.00	284,980.98	0.02
489	HANESBRANDS INC	-	HBI US	纽约证券交易所	美国	2,689.00	278,571.18	0.02
490	CIMAREX ENERGY CO	-	XEC US	纽约证券交易所	美国	757.00	277,198.82	0.02
491	MACY'S INC	-	M US	纽约证券交易所	美国	2,298.00	272,532.23	0.02
492	DISCOVERY INC - A	-	DISCA US	纳斯达克交易所	美国	1,176.00	268,599.33	0.02
493	IPG PHOTONICS CORP	-	IPGP US	纳斯达克交易所	美国	264.00	266,901.60	0.02
494	HELMERICH & PAYNE	-	HP US	纽约证券交易所	美国	806.00	255,444.59	0.02
495	ROLLINS INC	-	ROL US	纽约证券交易所	美国	1,047.00	242,203.34	0.02
496	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	-	ADS US	纽约证券交易所	美国	304.00	237,949.81	0.02
497	H&R BLOCK INC	-	HRB US	纽约证券交易所	美国	1,452.00	237,839.31	0.02
498	NORDSTROM INC	-	JWN US	纽约证券交易所	美国	796.00	227,286.55	0.02
499	L BRANDS INC	-	LB US	纽约证券交易所	美国	1,727.00	218,307.90	0.01
500	UNDER ARMOUR INC-CLASS A	-	UAA US	纽约证券交易所	美国	1,399.00	210,809.60	0.01
501	GAP INC/THE	-	GPS US	纽约证券交易所	美国	1,582.00	195,122.64	0.01
502	UNDER ARMOUR INC-CLASS C	-	UA US	纽约证券交易所	美国	1,447.00	193,613.69	0.01
503	COTY INC-CL A	-	COTY US	纽约证券交易所	美国	2,198.00	172,503.99	0.01
504	NEWS CORP - CLASS B	-	NWS US	纳斯达克交易所	美国	905.00	91,608.32	0.01

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	MICROSOFT CORP	MSFT US	23,092,295.65	3.29
2	APPLE INC	AAPL US	20,694,430.57	2.94
3	AMAZON.COM INC	AMZN US	16,734,405.79	2.38
4	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	8,229,008.07	1.17
4	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	7,873,551.08	1.12
5	FACEBOOK INC-CLASS A	FB US	9,967,725.08	1.42
6	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	9,246,186.99	1.32
7	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	7,947,640.08	1.13
8	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	7,759,102.97	1.10
9	WALT DISNEY CO/THE	DIS US	7,423,870.23	1.06
10	EXXON MOBIL CORP	XOM US	6,713,658.27	0.96
11	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	6,408,059.40	0.91
12	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	6,390,460.70	0.91
13	AT&T INC	T US	5,708,029.85	0.81
14	BANK OF AMERICA CORP	BAC US	5,482,510.25	0.78
15	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	5,391,227.78	0.77
16	VERIZON COMMUNICATIONS INC	VZ US	5,352,180.12	0.76
17	MASTERCARD INC - A	MA US	5,178,817.44	0.74
18	HOME DEPOT INC	HD US	5,007,834.56	0.71
19	CHEVRON CORP	CVX US	4,869,911.12	0.69
20	INTEL CORP	INTC US	4,850,953.87	0.69

注：“买入金额”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。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	APPLE INC	AAPL US	4,322,569.33	0.61
2	MICROSOFT CORP	MSFT US	2,729,713.25	0.39
3	AMAZON.COM INC	AMZN US	1,895,563.73	0.27
4	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	943,197.27	0.13
4	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	873,664.24	0.12
5	BANK OF AMERICA CORP	BAC US	1,645,247.70	0.23
6	WALT DISNEY CO/THE	DIS US	1,571,456.67	0.22
7	DUPONT DE NEMOURS INC	DD US	1,506,022.33	0.21
8	CIGNA CORP	CI US	1,361,904.84	0.19

9	ORACLE CORP	ORCL US	1,313,919.10	0.19
10	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	1,291,263.25	0.18
11	RED HAT INC	RHT US	1,271,493.33	0.18
12	TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	TFCFA US	1,268,825.03	0.18
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	1,127,914.65	0.16
14	WELLS FARGO & CO	WFC US	1,044,949.13	0.15
15	FACEBOOK INC-CLASS A	FB US	1,037,479.33	0.15
16	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	991,289.93	0.14
17	CITIGROUP INC	C US	928,771.82	0.13
18	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	880,092.38	0.13
19	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	846,053.53	0.12
20	HOME DEPOT INC	HD US	841,765.35	0.12

注：“卖出金额”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。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	559,154,114.03
卖出收入（成交）总额	93,140,603.47

注：本项“买入成交总金额”、“卖出成交总金额”按买入、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。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	期货投资	S&P500 EMINI FUT Mar20	1,763,269.43	0.12

注：期货投资采用当日无负债结算制度，其公允价值与相关的期货结算暂收款（结算所得的持仓损益）相抵销后的净额为 0。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	3,340,204.56
2	应收证券清算款	94,660.46
3	应收股利	1,202,281.17
4	应收利息	6,758.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,643,905.04

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.11.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
8,075	86,788.77	67,941,933.00	9.69%	152,278,192.00	21.73%	480,599,160.00	68.58%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总 份额比例
1	平安资产—工商银行—平安资产创赢 15 号资产管理产品	8,643,500.00	1.23%
2	中国农业银行股份有限公司—泰达宏利泰和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）	5,520,000.00	0.79%
3	DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT	5,262,362.00	0.75%
4	中国建设银行股份有限公司—嘉实领航资产配置混合型基金中基金（FOF）	4,800,000.00	0.68%
5	中国农业银行股份有限公司—建信优享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）	4,590,400.00	0.66%
6	李婴	4,500,000.00	0.64%
7	林晓辉	4,496,304.00	0.64%
8	赵兵	3,408,400.00	0.49%
9	上海培蓝股权投资基金管理有限公司—培蓝价值 1 号私募证券投资基金	3,300,000.00	0.47%
10	国泰基金—申万宏源证券有限公司—国泰基金—太阳升 5 号单一资产管理计划	2,977,000.00	0.42%
	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	480,599,160.00	68.58%

注：前十名持有人为除博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金之外的前十名持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

9.4 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

- 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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013 年 12 月 5 日)基金份额总额	565,043,200.00
本报告期期初基金份额总额	438,819,285.00
本报告期基金总申购份额	427,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	165,000,000.00

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	700,819,285.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 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：基金管理人于 2019 年 8 月 24 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》，董良泓先生不再担任博时基金管理有限公司副总经理职务。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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 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。本报告期内本基金应付审计费 50,000 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	佣金	占当期佣金总	

			交总额的比例		量的比例	
Morgan Stanley Asia Limited	-	638,061,149.64	100.00%	150,193.48	100.00%	

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，在多家券商开立了券商交易账户。

1、基金券商交易账户的选择标准如下：

(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、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司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、基金券商交易账户的选择程序如下：

(1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构；

(2) 基金管理人在被选中的证券经营机构开立交易账户。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11.8 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根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金法律文件的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-31
2	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-31
3	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（摘要）	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-31
4	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-31
5	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资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站	2019-12-31
6	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年境外主要市场节假日暂停申购赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-27
7	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年 12 月 25 日暂停申购、赎回的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-24
8	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年 11 月 28 日暂停申购、赎回的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-26

9	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 3 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站	2019-10-23
10	关于博时标普 500ETF 基金一级申赎代办券商名单	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-09-02
11	关于博时旗下部分开放式基金增加上海朝阳永续基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-08-31
12	关于博时旗下部分开放式基金增加华瑞保险销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-08-30
13	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年半年度报告（正文）	上海证券报、基金管理人网站	2019-08-27
14	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年半年度报告（摘要）	上海证券报、基金管理人网站	2019-08-27
15	关于博时旗下部分开放式基金增加西藏东方财富证券股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-08-16
16	关于博时旗下部分开放式基金增加浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-08-15
17	20190812 关于博时旗下部分开放式基金增加玄元保险代理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-08-12
18	关于博时旗下部分开放式基金增加北京展恒基金销售股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-08-05
19	关于博时旗下部分开放式基金增加国信证券为代销机构的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-08-02
20	关于博时旗下部分开放式基金增加洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-07-25
21	20190722 关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加西安银行股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-07-22
22	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书 2019 年第 2 号（正文）	上海证券报、基金管理人网站	2019-07-20
23	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书 2019 年第 2 号（摘要）	上海证券报、基金管理人网站	2019-07-20
24	关于博时旗下部分开放式基金增加中信建投证券为代销机构的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-07-18
25	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	上海证券报、基金管理人网站	2019-07-18
26	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加上海长量基金销售有限公司为代销机构并参	上海证券报、基金管理人网站	2019-07-12

	加其费率优惠活动的公告		
27	关于博时旗下部分开放式基金增加部分券商为代销机构的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-05-24
28	关于博时旗下部分开放式基金增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-05-22
29	关于博时旗下部分开放式基金增加北京唐鼎耀华基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-05-16
30	关于博时旗下部分开放式基金增加中信建投证券为代销机构的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-04-30
31	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站	2019-04-22
32	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机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	2019-03-29
33	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年年度报告（摘要）	上海证券报、基金管理人网站	2019-03-29
34	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年年度报告（正文）	上海证券报、基金管理人网站	2019-03-29
35	关于博时旗下部分开放式基金增加江苏汇林保大基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-03-25
36	关于博时旗下部分基金增加浙江民泰商业银行为代销机构的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-03-14
37	关于博时旗下部分开放式基金参加泉州银行费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-02-28
38	关于博时旗下部分开放式基金增加广发银行股份有限公司为代销机构的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-02-26
39	关于博时旗下部分开放式基金增加四川天府银行股份有限公司为代销机构的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-02-25
40	关于标普 500ETF 基金新增国都证券为申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-02-20
41	关于博时旗下部分开放式基金增加北京新浪仓石基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-02-20
42	关于博时旗下部分开放式基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-01-29
43	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站	2019-01-19
44	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书 2019 年第 1 号（正文）	上海证券报、基金管理人网站	2019-01-19
45	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金招	上海证券报、基金管理人网站	2019-01-19

	募说明书 2019 年第 1 号（摘要）		
46	关于博时旗下部分开放式基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019-01-09

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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
博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	248,499,160.00	282,500,000.00	50,400,000.00	480,599,160.00	68.58%

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 13.1.1 中国证监会批准博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 13.1.2 《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 13.1.3 《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 13.1.5 报告期内博时标普 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
- 13.1.6 博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 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
二〇二〇年三月二十七日