

博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金

2020 年第 4 季度报告

2020 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年一月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时上证 50ETF
场内简称	证券简称：上 50ETF，扩位证券简称：上证 50 指数 ETF
基金主代码	510710
交易代码	510710
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2015 年 5 月 27 日
报告期末基金份额总额	168,218,871.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，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。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。</p> <p>本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具，包括融资融券等。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本基金将通过对权证标的证券的基本面以及资产支持证券基础资产及结构设计的研究，结合多种定价模型，根据基金资产组合情况适度进行权证及资产支持证券的投资。</p> <p>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争取不超过 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数，即上证 50 指数。该指数属于价格指数。
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，属于高风险/高收益的开放式基金。
基金管理人	博时基金管理有限公司

基金托管人
招商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2020年10月1日-2020年12月31日)
1.本期已实现收益	71,549,949.66
2.本期利润	109,069,038.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.4965
4.期末基金资产净值	732,015,826.95
5.期末基金份额净值	4.3516

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

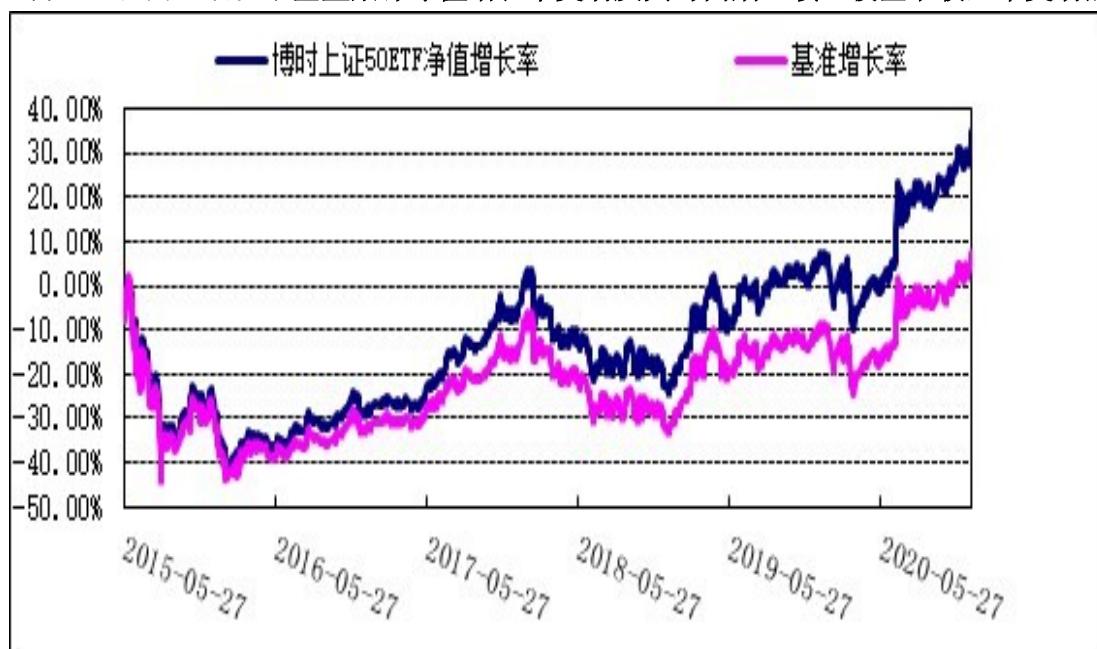
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.26%	0.99%	12.63%	0.99%	0.63%	0.00%
过去六个月	27.71%	1.35%	23.74%	1.36%	3.97%	-0.01%
过去一年	26.57%	1.38%	18.85%	1.39%	7.72%	-0.01%
过去三年	44.37%	1.32%	27.28%	1.33%	17.09%	-0.01%
过去五年	82.01%	1.21%	50.39%	1.21%	31.62%	0.00%
自基金合同生 效起至今	34.53%	1.43%	7.50%	1.47%	27.03%	-0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵云阳	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2015-10-08	-	10.4	赵云阳先生，硕士。2003年至2010年在晨星中国研究中心工作。2010年加入博时基金管理有限公司。历任量化分析师、量化分析师兼基金经理助理、博时特许价值混合型证券投资基金(2013年9月13日-2015年2月9日)、博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金(2015年4月29日-2016年5月30日)、博时中证淘金大数据100指数型证券投资基金(2015年5月4日-2016年5月30日)、博时裕富沪深300指数证券投资基金(2015年5月5日-2016年5月30日)、上证企债30交易型开放式指数证券投资基金(2013年7月11日-2018年1月26日)、深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金(2012年11月13日-2018年12月10日)、博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2012年11月13日-2018年12月10日)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2018年12月10日-2019年1月25日)、博时量化精选证券投资基金(2019年1月25日-2019年3月27日)、博时量化平衡证券投资基金(2019年3月27日-2019年5月27日)、博时量化多策略证券投资基金(2019年5月27日-2019年7月26日)、博时量化绝对收益证券投资基金(2019年7月26日-2020年5月27日)。

					月 10 日-2019 年 10 月 11 日)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金管理(2018 年 12 月 10 日-2019 年 10 月 11 日)、博时中证银行指数分级证券投资基金管理(2015 年 10 月 8 日-2020 年 8 月 5 日)、博时中证 800 证券保险指数分级证券投资基金管理(2015 年 5 月 19 日-2020 年 8 月 6 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金管理联接基金(2015 年 10 月 8 日一至今)、博时黄金交易型开放式证券投资基金管理(2015 年 10 月 8 日一至今)、博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金管理(2015 年 10 月 8 日一至今)、博时黄金交易型开放式证券投资基金管理联接基金(2016 年 5 月 27 日一至今)、博时中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金管理(2018 年 10 月 19 日一至今)、博时中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金管理联接基金(2018 年 11 月 14 日一至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金管理(2019 年 9 月 20 日一至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金管理联接基金(2019 年 11 月 13 日一至今)、博时中证银行指数证券投资基金管理 (LOF) (2020 年 8 月 6 日一至今)、博时中证全指证券公司指数证券投资基金管理(2020 年 8 月 7 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	-	11.6	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管理联接基金(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管理(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管理(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管理联接基金(2016 年 5 月 16 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管理(2020 年 1 月 19 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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 9 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年四季度，海外主要市场指数全面上涨，其中，标普 500 上涨 11.69%，纳斯达克上涨 15.41%，日经 225 上涨 18.37%，英国富时 100 上涨 10.13%，法国 CAC40 上涨 15.57%，德国 DAX 指数上涨 7.51%，香港恒生指数上涨 16.08%。国内 A 股方面，基本处于上涨态势。汇率方面，人民币延续大幅升值趋势，季度涨 3.98%。债券市场方面，10 年期国债收益率先扬后抑，整体处于震荡趋势，当前收益率为 3.14%。

行情方面，2020 年四季度主流指数上涨，偏大盘的上证 50 上涨 12.63%、沪深 300 指数上涨 13.60%，偏小盘的中证 500 和中证 1000 仅分别上涨 2.82%、0.44%，创业板指受新能源车等板块带动表现最为抢眼，上涨 15.21%。行业方面，中信一级行业表现分化明显，其中表现居前的是有色金属、电力设备及新能源、食品饮料、汽车、家电，涨幅分别为 29.44%、29.38%、25.61%、21.57%、21.54%，跌幅较为靠前的行业是综合金融、传媒、商贸零售、通信、房地产，跌幅分别为 13.57%、11.78%、9.93%、8.75%、6.25%。

展望 2021 年一季度，宏观层面，当前疫苗逐渐落地，其效果会慢慢显现带来海外疫情慢慢好转，全球的修复弹性有望逐渐释放。2021 年一季度，逆周期政策效果短期延续可能会带来经济的短期周期高点。国内宏观政策保持可持续性，政策环境大起大落的担忧得到实质性缓解，关注结构性信用出清压力和微观流动性变化趋势。核心任务是构建双循环格局，供需两端发力，打造高水平供需动态平衡。供给侧方面以科技自主为支撑，强化国家战略科技力量，增强产业链供应链自主可控能力。需求侧管理重点是摆脱过去靠投资拉动模式，更多依靠消费升级、公共服务等。中美关系方面，新总统上任第一年往往聚焦国内事务，外部处于乐观窗口。

A 股市场结构较之前相对均衡，企业盈利增速持续好转，基本面或成为市场主要驱动力。一季度预期整体经济持续向上，内外循环驱动预计将成主旋律，权益市场仍有较为丰富的机会。我们对 A 股中长期

表现仍偏乐观，但需关注估值压力，更加强调仓位调整的灵活性，且重点把握结构性机会。在基本面成为市场主要关注点的背景下，建议重点关注龙头股。具体板块上，关注顺周期中复苏弹性较大的化工有色；竞争结构较好的白酒白电；基本面和政策支撑的高端制造、军工、景气度较高的光伏、新能源汽车及自主可控背景下的半导体、消费电子等板块。

在投资策略上，本基金作为一只被动的指数基金，我们会以最小化跟踪误差为目标，紧密跟踪标的指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长，希望通过本基金为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 4.3516 元，份额累计净值为 1.3453 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 13.26%，同期业绩基准增长率 12.63%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	706,410,778.74	96.41
	其中：股票	706,410,778.74	96.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	115,000.00	0.02
	其中：债券	115,000.00	0.02
	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	22,331,221.65	3.05
8	其他资产	3,839,789.46	0.52
9	合计	732,696,789.85	100.00

注：股票投资项包含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,873,730.77	0.26

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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	1,714,383.21	0.23
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	3,588,113.98	0.49

注：上述按行业分类的境内股票投资组合的合计项不包含可退替代款估值增值。

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	18,228,876.75	2.49
C	制造业	295,342,048.72	40.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	12,985,692.60	1.77
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8,874,756.44	1.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,957,719.00	2.59
J	金融业	296,658,641.80	40.53
K	房地产业	10,505,429.20	1.44
L	租赁和商务服务业	25,263,740.25	3.45
M	科学研究和技术服务业	16,004,736.00	2.19
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	702,821,640.76	96.01

注：上述按行业分类的境内股票投资组合的合计项不包含可退替代款估值增值。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	46,165	92,237,670.00	12.60

2	601318	中国平安	1,001,297	87,092,813.06	11.90
3	600036	招商银行	1,143,384	50,251,726.80	6.86
4	600276	恒瑞医药	343,579	38,295,315.34	5.23
5	601166	兴业银行	1,344,600	28,061,802.00	3.83
6	601888	中国中免	89,445	25,263,740.25	3.45
7	600887	伊利股份	562,576	24,961,497.12	3.41
8	600030	中信证券	787,800	23,161,320.00	3.16
9	601012	隆基股份	246,400	22,718,080.00	3.10
10	600031	三一重工	548,200	19,176,036.00	2.62

5.3.2 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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601995	中金公司	24,951.00	1,714,383.21	0.23
2	688390	固德威	2,585.00	573,146.20	0.08
3	688586	江航装备	16,436.00	496,367.20	0.07
4	688519	南亚新材	9,329.00	284,627.79	0.04
5	688286	敏芯股份	1,681.00	197,231.73	0.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	115,000.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	115,000.00	0.02

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113616	韦尔转债	1,150	115,000.00	0.02

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IH2103	IH2103	20.00	21,820,800.00	1,849,800.00	-
公允价值变动总额合计(元)					1,849,800.00
股指期货投资本期收益(元)					526,514.56
股指期货投资本期公允价值变动(元)					2,728,950.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除招商银行(600036)、兴业银行(601166)、中信证券(600030)的发行主体外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

主要违规事实：2020年8月25日，因存在以信贷资金用作银行承兑汇票保证金，虚增存款的违规行为，中国银行保险监督管理委员会金华监管分局对招商银行股份有限公司金华分行处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020年6月12日，因存在 1.为非法交易平台提供条码支付服务；2.为无证机构经营支付业务提供条码支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中一致性的规定等违规行为，中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司三明分行处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020年4月16日，因存在多名客户开户资料重要信息填写缺失、未对高龄客户职业信息填写异常进行核实、同一客户同日填写的两份信息登记材料内容不一致等违规行为，中国证券监督管理委员会北京监管局对中信证券股份有限公司北京紫竹院路证券营业部处以责令整改的行政处罚。

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

5.11.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,307,389.02
2	应收证券清算款	526,885.36
3	应收股利	-
4	应收利息	5,515.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,839,789.46

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601995	中金公司	1,714,383.21	0.23	首次公开发行限售
2	688390	固德威	573,146.20	0.08	首次公开发行限售
3	688586	江航装备	496,367.20	0.07	首次公开发行限售
4	688519	南亚新材	284,627.79	0.04	首次公开发行限售
5	688286	敏芯股份	197,231.73	0.03	首次公开发行限售

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	246,218,871.00
报告期基金总申购份额	174,300,000.00
减：报告期基金总赎回份额	252,300,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	168,218,871.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额
博时上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2020-10-01~2020-12-31	181,659,901.00	-	79,320,000.00	102,339,901.00 60.84%

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，基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2020 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 246 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 13294 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 4012 亿元人民币，累计分红逾 1373 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

其他大事件

2020年12月31日，在中国证券业协会主办，中国期货业协会、中国证券投资基金业协会协办的第七届证券期货科学技术奖中，博时基金、金证财富《新一代投资决策支持系统》荣获证券期货科学技术奖三等奖。

2020年12月，大众证券报“2020中国基金风云榜”揭晓，博时基金获“2020年度十大风云基金公司”，博时医疗保健行业获“2020年度十大风云基金产品”。

2020年12月23日，在信息时报“金狮奖”中，博时基金荣获“年度最具核心竞争力基金公司”。

2020年12月15日，“聚中国 投未来·2021新财富资产管理年会”在深圳举办，博时基金荣获2020新财富最智慧投资机构。

2020年12月11日，由证券时报·券商中国主办的“2020中国金融科技先锋榜”隆重揭晓，博时基金荣登“中国公募基金智能投研先锋榜”。

2020年12月10日，金融界“第五届智能金融国际论坛暨2020金融界领航中国年度盛典”，博时基金荣获四项大奖。博时基金董事长江向阳获“杰出年度基金领袖奖”，博时基金荣获“杰出年度创新基金公司奖”、“杰出年度基金公司奖”、“杰出年度海外投资基金公司奖”。

2020年12月10日，香港中资基金业协会（HKCAMA）和彭博（Bloomberg）2020年度“离岸中资基金大奖”中，博时国际荣膺“最佳跨境业务”大奖，“博时-东方红大中华债券基金”荣膺“最佳总回报-大中华区固定收益（1年）”亚军。

2020年12月8日，北京商报社主办的“数字金融 争渡未来·2020年度北京金融论坛”在北京举办，博时基金荣获2020年度北京金融业十大品牌·产品创新卓越奖。

2020年12月2日，经济观察报举办的2020卓越金融企业盛典举行，博时基金荣获“年度卓越综合实力基金公司”称号。

2020年11月28日，由21世纪经济报道主办的第五届财经“金帆奖”评选中，博时基金荣获“2020年度卓越基金管理公司”。

2020年11月27日，国际金融报“第三届CSR先锋论坛暨2020先锋奖项颁奖典礼”在北京举办，凭借在社会责任方面的贡献，博时基金荣获2020年度社会责任先锋案例。

2020年11月20日，2020第一财经金融价值榜·颁奖典礼在上海举办，博时基金获选“2020年度第一财经金融价值榜”年度基金公司管理人。

2020年11月19日，由思维财经&投资者网主办的思维财经投资者年会暨“金桥奖”颁奖盛典上，博时基金荣获“金桥奖·年度最具投资价值基金公司”。

2020年11月，联合国负责任投资原则组织(UN PRI)发布2020年度签署方评估报告。博时基金在衡量公司整体ESG管理水平的“战略与治理”模块，获得了首批最高评价“A+”评定。

2020年10月28日，由《中国基金报》主办的“2020中国机构投资者峰会”在上海浦东香格里拉酒店举行。第七届中国基金业英华奖中，博时基金陈凯杨荣获“五年期纯债投资最佳基金经理”，过均荣获“五年期二级债投资最佳基金经理”，何凯荣获“三年期海外固收投资最佳基金经理”及“五年期海外固收投资最佳基金经理”。第二届中国公募基金英华奖中，博时基金荣获“2019年度最佳营销策划案例（最

佳创意）”、“2019年度最佳社会公益实践案例”、“2019年度最佳电商业务发展基金公司”、“2019年度最佳创新基金产品”、“2019年度最佳营销策划案例（最佳综合）”、“2019年度最佳指数增强基金”奖项。

2020年10月23日，国际金融报主办的“2020国际先锋金融机构高峰论坛暨颁奖典礼”在上海举办，博时基金董事长江向阳荣获“金融行业先锋领袖”、博时基金荣获“先锋证券投资机构”。

2020年10月16日，由《每日经济新闻》主办的“2020中国金融每经峰会资本市场高峰论坛暨2020中国金鼎奖颁奖典礼”在上海举行，博时基金成功斩获“固收+最具人气基金公司奖”和“最具影响力基金公司-专户一对多”奖项，博时基金投资经理王晓冬荣获“最具实力权益类专户基金经理”奖项。

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

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

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

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

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

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

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

2020年3月26日，Morningstar晨星（中国）2020年度基金评选结果揭晓，博时信用债券在参选的同

类 428 只基金中脱颖而出，摘得晨星“2020 年度激进债券型基金奖”。

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

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

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 9.1.2 《博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 9.1.5 博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本
- 9.1.6 报告期内博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二一年一月二十二日