

博时中证新能源汽车交易型开放式指数 证券投资基金 2021年第2季度报告 2021年6月30日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年七月二十一日

§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。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时新能源汽车ETF
场内简称	新能汽车
基金主代码	159824
交易代码	159824
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年12月10日
报告期末基金份额总额	306,135,070.00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。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于0.2%，预期年化跟踪误差不超过2%。
投资策略	1、组合复制策略本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。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。特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。2、债券（除可转换债券）投资策略、3、资产支持证券投资策略、4、可转换债券投资策略、5、港股通标的股票投资策略、6、衍生品投资策略、7、融资及转融通证券出借
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证新能源汽车指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于中高风险中高收益的开放式基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证新能源汽车指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	华泰证券股份有限公司

§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 (2021年4月1日-2021年6月30日)
1.本期已实现收益	56,655,910.51
2.本期利润	194,563,481.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.4013
4.期末基金资产净值	406,095,873.18
5.期末基金份额净值	1.3265

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

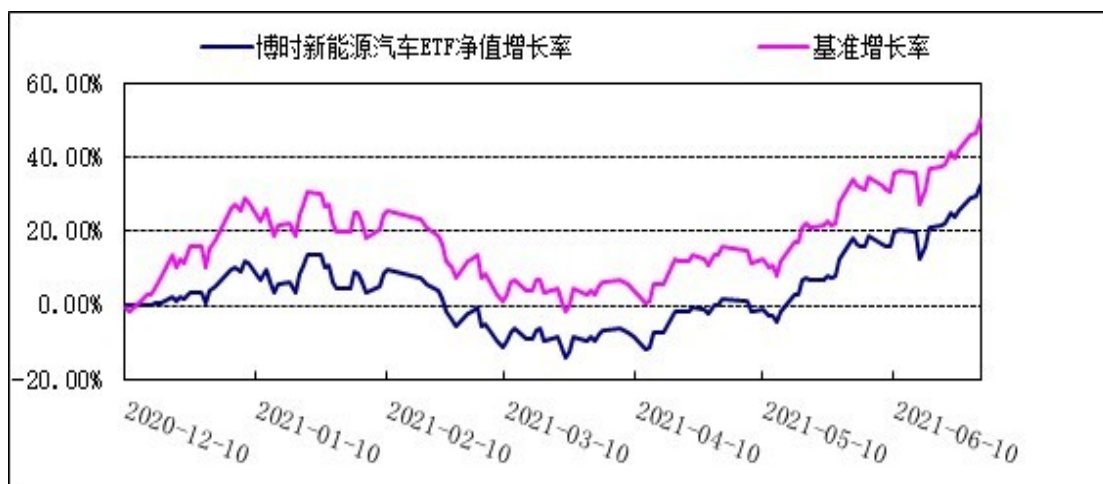
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 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	46.98%	2.23%	45.74%	2.26%	1.24%	-0.03%
过去六个月	26.33%	2.45%	27.36%	2.53%	-1.03%	-0.08%
自基金合同生 效起至今	32.65%	2.33%	49.98%	2.57%	-17.33%	-0.24%

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



注：本基金的基金合同于2020年12月10日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尹浩	基金经理	2020-12-10	-	8.9	尹浩先生，硕士。2012年起先后在华宝证券、国金证券工作。2015年加入博时基金管理有限公司。历任高级研究员、高级研究员兼基金经理助理。现任上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2019年10月11日一至今)、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(2019年10月11日一至今)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019年10月11日一至今)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金(2019年10月11日一至今)、博时中证5G产业50交易型开放式指数证券投资基金(2020年3月27日一至今)、博时中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金(2020年12月10日一至今)、博时中证智能消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2020年12月30日一至今)的基金经理。

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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13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

2021年第二季度，海外主要市场指数多数上涨，标普500上涨8.17%，纳斯达克上涨9.49%，英国富时100上涨4.82%，法国CAC40上涨7.26%，德国DAX指数上涨3.48%，香港恒生指数上涨1.58%，而日经225则回调1.33%。国内A股方面中小盘指数表现较强，特别是科技属性指数表现抢眼。汇率方面，人民币继续升值，相对于美元，人民币升值1.46%。债券市场方面，10年期国债收益率下行11个BP，6月底收益率为3.078%，美国债10年期收益率下行29个BP，月底收益率为1.450%，全球流动性相对于一季度有明显改善。行情方面，2021年第二季度，主流指数多数上涨，仅偏大盘的上证50下跌，跌幅为1.15%、而沪深300指数下跌3.48%，偏小盘的中证500上涨8.86%，中证1000上涨12.56%，偏科技的指数的创业板指大涨26.05%，科创50上涨27.23%。行业方面，中信一级行业中表现居前的是电力设备及新能源、电子、综合、汽车、基础化工，涨幅分别为31.38%、23.77%、22.87%、22.64%、21.39%，跌幅较为靠前的行业是农林牧渔、房地产、家电、消费者服务、非银行金融，跌幅分别为8.48%、7.59%、7.22%、5.84%、5.64%。

展望2021年三季度，宏观上，全球经济从分化明显的K型复苏将逐渐走向更加均衡和全面的复苏，经济基本面整体保持一定韧性，国内经济也将进一步走向均衡化，出口和地产高位逐渐温和放缓，受益于疫情相关的出口产品景气高位逐渐回落，服务业和大众消费稳健复苏。通胀方面，受益于全球需求复苏，PPI同比仍维持较高水平。猪肉价格产能出清较缓，缺乏趋势反转的基础，CPI整体仍在较低水平。流动性上，流动性或边际收敛但整体仍充裕。市场情绪上，交易量持续处于高位，短期市场情绪较为乐观，但结构分化明显。

A股仓位建议保持中性，风格整体偏向盈利景气较高的科创板。建议关注具备长期趋势和短期盈利支撑的新能源汽车板块。长期来看，在能源革命、碳中和等多因素推动下，新能源汽车渗透率逐渐提高，产业空间广阔。短期在各国政策落实下，新能源汽车销量增长迅速，锂电需求释放明显，利好新能源产业链。

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2021年06月30日，本基金基金份额净值为1.3265元，份额累计净值为1.3265元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为46.98%，同期业绩基准增长率为45.74%。

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	400,819,360.68	98.15
	其中：股票	400,819,360.68	98.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,053,857.48	0.26
	其中：债券	1,053,857.48	0.26
	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	3,302,402.85	0.81
8	其他各项资产	3,186,524.96	0.78
9	合计	408,362,145.97	100.00

注：1、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

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	5,850.78	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	400,514,774.90	98.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	39,993.82	0.01
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	136,135.99	0.03
J	金融业	34,721.10	0.01
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	44,438.33	0.01
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	400,814,306.68	98.70
----	----------------	-------

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 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 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	002594	比亚迪	181,800	45,631,800.00	11.24
2	300750	宁德时代	85,200	45,564,960.00	11.22
3	002812	恩捷股份	134,390	31,460,699.00	7.75
4	300014	亿纬锂能	287,600	29,890,268.00	7.36
5	300124	汇川技术	388,421	28,844,143.46	7.10
6	002460	赣锋锂业	204,000	24,702,360.00	6.08
7	002709	天赐材料	145,030	15,457,297.40	3.81
8	300450	先导智能	256,361	15,417,550.54	3.80
9	002340	格林美	1,211,400	11,326,590.00	2.79
10	002074	国轩高科	259,600	11,308,176.00	2.78

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）	1,053,857.48	0.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,053,857.48	0.26

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	127036	三花转债	5,452	714,157.48	0.18
2	127037	银轮转债	3,397	339,700.00	0.08

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除国轩高科(002074)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11月2日，因存在一、控股股东非经营性资金占用、二、违规使用募集资金、三未在规定期限内披露业绩预告、四、政府补助披露不及时等违规行为，深圳证券交易所对国轩高科股份有限公司处以通报批评的处分。

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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,956,290.56
2	应收证券清算款	1,150,709.07
3	应收股利	-
4	应收利息	3,909.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	3,186,524.96

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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	682,135,070.00
报告期间基金总申购份额	181,000,000.00

减：报告期期间基金总赎回份额	557,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	306,135,070.00

§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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2021 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 276 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 15482 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 4383 亿元人民币，累计分红逾 1465 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。

§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中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 9.1.2 《博时中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时中证新能源汽车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 报告期内博时中证新能源汽车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询，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
二〇二一年七月二十一日