

# 博时中证央企创新驱动交易型开放式指数 证券投资基金 2021年第4季度报告 2021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：二〇二二年一月二十四日

## §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2022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2021年10月1日起至12月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	博时央企创新ETF
场内简称	央创ETF
基金主代码	515900
交易代码	515900
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年9月20日
报告期末基金份额总额	4,030,646,521.00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最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。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%。其他投资策略包括：存托凭证投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略等。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证央企创新驱动指数收益率
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，跟踪中证央企创新驱动指数，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	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 (2021年10月1日-2021年12月31日)
1.本期已实现收益	377,075,562.41
2.本期利润	54,283,327.27
3.加权平均基金份额本期利润	0.0147

4.期末基金资产净值	5,419,261,871.02
5.期末基金份额净值	1.3445

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。

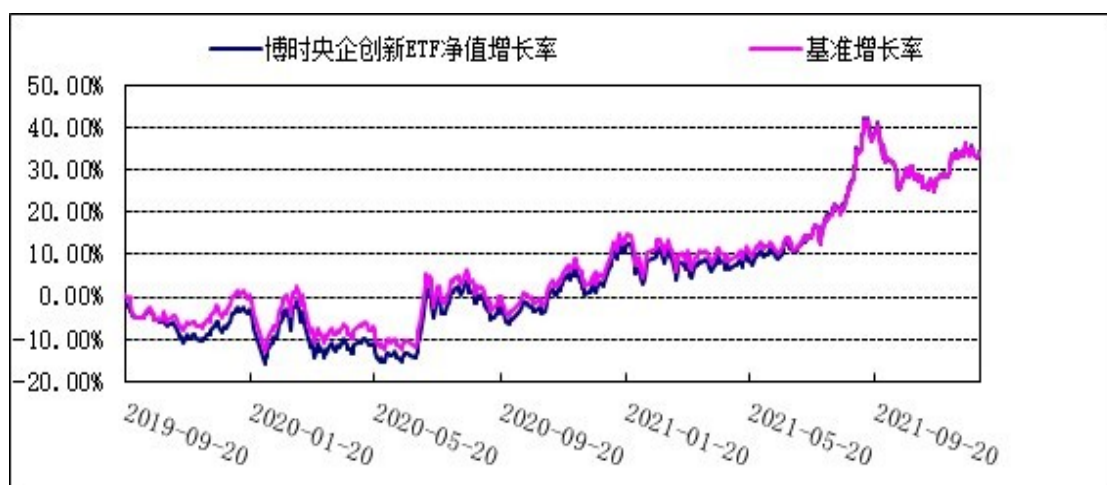
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 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	1.06%	1.01%	0.91%	1.01%	0.15%	0.00%
过去六个月	19.86%	1.18%	19.06%	1.19%	0.80%	-0.01%
过去一年	28.43%	1.15%	25.96%	1.16%	2.47%	-0.01%
自基金合同生 效起至今	34.45%	1.29%	34.41%	1.31%	0.04%	-0.02%

### 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 投资总监/ 基金经理	2019-09-20	-	11.3	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

				<p>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10月11日)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金(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(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(2015年5月19日-2020年8月6日)的基金经理、指数与量化投资部投资副总监。现任指数与量化投资部投资总监兼博时上证50交易型开放式指数证券投资基金(2015年10月8日一至今)、博时黄金交易型开放式证券投资基金(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联接基金(2016年5月27日一至今)、博时中证央</p>
--	--	--	--	--

					<p>企结构调整交易型开放式指数证券投资基金(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(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(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(2020年8月7日一至今)、博时中证医药50交易型开放式指数证券投资基金(2021年7月22日一至今)的基金经理。</p>
杨振建	基金经理	2019-09-20	-	8.3	<p>杨振建先生，博士。2013年至2015年在中证指数有限公司工作（期间借调中国证监会任产品审核员）。2015年加入博时基金管理有限公司。历任研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理助理、博时中证银联智惠大数据100指数型证券投资基金(2018年12月3日-2021年7月16日)基金经理。现任博时中证淘金大数据100指数型证券投资基金(2018年12月3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(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联接基金(2019年11月13日一至今)、博时裕富沪深300指数证券投资基金(2020年12月23日一至今)的基金经理。</p>

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

## 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7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

宏观层面，稳增长已成为了当前政策主线，目前流动性还是延续整体充裕性，总体上，货币流动性无需过度担忧，短期由于经济扰动货币政策有望保持持续放松，市场机会需要紧扣上市公司的盈利预期变化。当前我们需要持续关注不同板块景气趋势的变化，适当保持仓位的灵活性，把握结构性机会。2021 整体市场风格切换比较剧烈，但是中央企业整体估值较低，周期上游、高端制造板块占比较高。从均衡配置的角度考虑，可以持续关注质地优良的低估值央企资产。本基金利用数量化手段对组合进行管理，严格控制与指数跟踪偏离。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 1.3445 元，份额累计净值为 1.3445 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 1.06%，同期业绩基准增长率为 0.91%。

## 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	5,353,355,390.35	98.56
	其中：股票	5,353,355,390.35	98.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	77,592,861.86	1.43
8	其他各项资产	548,574.97	0.01
9	合计	5,431,496,827.18	100.00

注：1、股票投资项包含可退替代款估值增值；

2、截至报告期末，股票投资中转融通融出股票金额 80,963,095.00 元，净值占比 1.49%。

## 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	-	-
B	采矿业	337,985,571.57	6.24
C	制造业	2,813,857,441.34	51.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	215,949,505.20	3.98
E	建筑业	1,223,585,168.51	22.58
F	批发和零售业	133,211.54	0.00
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	588,352,763.26	10.86
J	金融业	158,314,510.81	2.92
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	15,152,106.95	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	14,899.39	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,353,363,340.35	98.78

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	002415	海康威视	5,358,014	280,331,292.48	5.17
2	601668	中国建筑	55,075,308	275,376,540.00	5.08
3	600406	国电南瑞	6,280,071	251,391,242.13	4.64
4	601669	中国电建	27,787,266	224,521,109.28	4.14
5	002202	金风科技	10,425,182	171,702,747.54	3.17
6	601390	中国中铁	28,579,111	165,473,052.69	3.05
7	600019	宝钢股份	22,255,747	159,351,148.52	2.94
8	601766	中国中车	25,838,491	157,356,410.19	2.90
9	600036	招商银行	3,074,711	149,769,172.81	2.76
10	601186	中国铁建	18,811,387	146,728,818.60	2.71

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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中国建筑(601668)、宝钢股份(600019)、招商银行(600036)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：2021年10月18日，因中国建筑股份有限公司存在危大工程管理不到位的情形，重庆市住房和城乡建设委员会对其处以罚款等处罚。

主要违规事实：2021年7月14日，因存在重大事故隐患未及时报告的违规行为，上海市应急管理局对宝山钢铁股份有限公司处以警告、罚款的行政处罚。

主要违规事实：2021年5月21日，因存在1、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产。2、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品。3、理财产品之间风险隔离不到位等违规行为，中国银行保险监督管理委员会对招商银行股份有限公司处以罚款的公开处罚。

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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	136,419.60
2	应收证券清算款	373,092.76
3	应收股利	-
4	应收利息	39,062.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	548,574.97

### 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

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	601669	中国电建	7,711,552.00	0.14	转融通融出
2	002202	金风科技	2,951,424.00	0.05	转融通融出
3	601766	中国中车	2,131,500.00	0.04	转融通融出
4	601668	中国建筑	250,000.00	0.00	转融通融出

### 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	3,829,646,521.00
报告期期间基金总申购份额	703,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	502,000,000.00

报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	4,030,646,521.00

## §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份额。

### 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	份额占比
机构	1	2021-10-01~2021-10-26;2021-10-28~2021-12-31	860,259,355.00	374,674,700.00	-	1,234,934,055.00	30.64%
	2	2021-10-01~2021-10-26;2021-10-28~2021-12-31	884,980,200.00	-	-	884,980,200.00	21.96%
	3	2021-10-01~2021-10-26;2021-10-28~2021-12-01	868,332,000.00	-	477,351,300.00	390,980,700.00	9.70%

#### 产品特有风险

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。

## 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 12 月 31 日，博时基金公司共管理 311 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 16687 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 5366 亿元人民币，累计分红逾 1561 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

2021 年 12 月 15 日，人民银行公示了 2020 年度金融科技发展奖获奖项目，博时基金“新一代投资决策支持系统”荣获二等奖。

2021 年 12 月 1 日，广东省人民政府官网发布《关于 2020 年广东金融创新奖评选结果的通报》，博时基金“新一代投资决策支持系统”荣获三等奖。

2021 年 11 月 20 日，第五届中国海外基金金牛奖评选揭晓，博时基金海外全资子公司博时基金（国际）有限公司旗下的博时大中华债券基金凭借优异的业绩，荣膺“一年期金牛海外中国债券基金”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中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金设立的文件

9.1.2 《博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

9.1.3 《博时中证央企创新驱动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 博时中证央企创新驱动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 报告期内博时中证央企创新驱动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  
二〇二二年一月二十四日