

# 博时创业板指数证券投资基金

## 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行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 2 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	博时创业板指数	
基金主代码	010785	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 4 月 2 日	
报告期末基金份额总额	11,682,110.61 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 0.35%，预期年化跟踪误差不超过 4%。	
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 0.35%，预期年化跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金日均跟踪偏离度和跟踪误差变大，基金管理人应采取合理措施，避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。其他投资策略包括：债券（除可转换债券）投资策略、资产支持证券的投资策略、可转换债券投资策略、衍生品投资策略、港股通标的股票投资策略、融资及转融通证券出借、流通受限证券投资策略等	
业绩比较基准	创业板指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%	
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。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪创业板指数，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。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。	
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	
下属分级基金的基金简称	博时创业板指数 A	博时创业板指数 C
下属分级基金的交易代码	010785	010786
报告期末下属分级基金的份额总额	6,428,672.41 份	5,253,438.20 份

## §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 2 日（基金合同生效日）-2021 年 6 月 30 日)
--------	--

	博时创业板指数 A	博时创业板指数 C
1.本期已实现收益	289,470.07	298,776.73
2.本期利润	750,211.29	1,518,112.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.1636	0.0189
4.期末基金资产净值	7,475,441.57	6,099,236.89
5.期末基金份额净值	1.1628	1.1610

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

#### 1. 博时创业板指数 A：

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
自基金合同 生效起至今	16.28%	1.15%	22.26%	1.52%	-5.98%	-0.37%

#### 2. 博时创业板指数 C：

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
自基金合同 生效起至今	16.10%	1.15%	22.26%	1.52%	-6.16%	-0.37%

### 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

#### 1. 博时创业板指数 A：



#### 2. 博时创业板指数 C：



注：本基金的基金合同于2021年4月2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，截止报告期末基金尚未完成建仓。

## §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		
万琼	基金经理	2021-04-02	-	14.3	万琼女士，硕士。2004年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理、博时富时中国A股指数证券投资基金(2017年9月29日-2019年9月5日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015年6月8日-2019年10月11日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015年6月8日-2019年10月11日)的基金经理。现任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联接基金(2015年10月8日一至今)、博时标普500交易型开放式指数证券投资基金(2015年10月8日一至今)、博时中证500交易型开放式指数证券投资基金(2019年8月1日一至今)、博时中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2019年12月30日一至今)

					今)、博时中证可持续发展 100 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 1 月 19 日一至今)、博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 3 月 20 日一至今)、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 3 日一至今)、博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 30 日一至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 3 月 18 日一至今)、博时创业板指数证券投资基金(2021 年 4 月 2 日一至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 5 月 11 日一至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 5 月 17 日一至今)、博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 6 月 8 日一至今)的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，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 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 2 季度国内和海外疫情出现反复，但整体向好的态势不变。全球经济整体处于后疫情的恢复增

长阶段。国内经济进入平稳增长阶段，1-5月我国社会零售销售总额达到17.4万亿，同比2019年增长8.1%。工业生产从去年疫情中完全恢复，PPI环比增速持续上升。出口维持高位，但高速增长势头出现停滞，5月新出口订单指数下滑至48.3%。美国经济随着疫苗的接种，经济逐步开放，经济恢复良好，5月美国PMI指数再次走高，工业生产、消费和房地产均保持了良好的增长。

行情方面，2季度A股市场整体表现出色，特别是以创业板和科创板为代表的成长板块，上证50、沪深300表现相对落后。具体看，创业板指数上涨26.05%，科创50指数上涨27.23%，中证500指数上涨8.86%，沪深300上涨3.48%，上证50下跌1.15%。

展望2021年3季度，国内经济进一步走向均衡化发展，出口和地产高位逐渐温和放缓，服务业和大众消费稳健复苏。受全球经济复苏的拉动，预计PPI同比仍将维持较高水平。生猪养殖产能出清较慢，预计猪肉价格在3季度缺乏趋势反转基础，CPI整体仍维持较低水平。流动性方面，美元流动性和国内资金充裕的局面有边际收敛的可能，但整体仍较充裕，国内货币调控整体以稳为主，资金面不存在收缩的基础，只是在不同阶段政策力度和侧重点不同。3季度某些时间段资金面可能会出现阶段性的小波动，给风险资产带来一定扰动，但不会改变权益市场长期的配置价值。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2021年06月30日，本基金A类基金份额净值为1.1628元，份额累计净值为1.1628元，本基金C类基金份额净值为1.1610元，份额累计净值为1.1610元，报告期内，本基金A类基金份额净值增长率为16.28%，本基金C类基金份额净值增长率为16.10%，同期业绩基准增长率为22.26%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金曾于2021年05月06日至2021年06月30日出现连续20个工作日资产净值低于五千万元的情形。

## §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	12,892,677.02	89.97
	其中：股票	12,892,677.02	89.97
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	1,027,065.88	7.17
8	其他各项资产	409,688.63	2.86
9	合计	14,329,431.53	100.00

## 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	248,920.00	1.83
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,074,296.80	66.85
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	14,208.00	0.10
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	859,430.60	6.33
J	金融业	971,489.80	7.16
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	41,745.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	406,448.00	2.99
N	水利、环境和公共设施管理业	48,977.00	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	948,744.82	6.99
R	文化、体育和娱乐业	278,417.00	2.05
S	综合	-	-
	合计	12,892,677.02	94.98

## 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	300750	宁德时代	3,800	2,032,240.00	14.97
2	300059	东方财富	27,220	892,543.80	6.58
3	300760	迈瑞医疗	1,400	672,070.00	4.95
4	300015	爱尔眼科	7,709	547,184.82	4.03
5	300122	智飞生物	2,400	448,152.00	3.30
6	300124	汇川技术	5,550	412,143.00	3.04
7	300014	亿纬锂能	3,900	405,327.00	2.99
8	300274	阳光电源	3,300	379,698.00	2.80
9	300782	卓胜微	700	376,250.00	2.77
10	300347	泰格医药	1,800	347,940.00	2.56

## 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 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。

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	10,537.40
2	应收证券清算款	162,578.91
3	应收股利	-
4	应收利息	261.40
5	应收申购款	236,310.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	409,688.63

### 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

项目	博时创业板指数 A	博时创业板指数 C
基金合同生效日基金份额总额	4,334,658.48	203,657,978.35
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,337,999.08	3,199,621.73
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,243,985.15	201,604,161.88
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,428,672.41	5,253,438.20

## §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创业板指数证券投资基金设立的文件

9.1.2 《博时创业板指数证券投资基金基金合同》

9.1.3 《博时创业板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 报告期内博时创业板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