

**博时中证新能源交易型开放式指数证券投资  
基金  
2021 年第 3 季度报告  
2021 年 9 月 30 日**

**基金管理人：博时基金管理有限公司**

**基金托管人：中信建投证券股份有限公司**

**报告送出日期：二〇二一年十月二十七日**

## §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。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 7 月 15 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	博时新能源 ETF
场内简称	证券简称：新能源 BS，扩位证券简称：新能源主题 ETF
基金主代码	516580
交易代码	516580
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 7 月 15 日
报告期末基金份额总额	178,124,083.00 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。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%。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。</p> <p>本基金的其他投资策略包括债券（除可转换债券）投资策略、存托凭证投资策略、资产支持证券的投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、衍生品投资策略、融资和转融通证券出借等。未来，随着投资工具的发展和丰富，</p>

	本基金可在不改变投资目标的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证新能源指数收益率。中证新能源指数由中证指数公司编制，选取涉及可再生能源生产、新能源应用、新能源存储以及新能源交互设备等业务的上市公司股票作为成份股，以反映新能源产业相关上市公司的整体表现。
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，跟踪中证新能源指数，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	中信建投证券股份有限公司

### §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 7 月 15 日 (基金合同生效日) - 2021 年 9 月 30 日)
1. 本期已实现收益	14,554,547.51
2. 本期利润	22,351,239.61
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0898
4. 期末基金资产净值	187,527,589.51
5. 期末基金份额净值	1.0528

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。

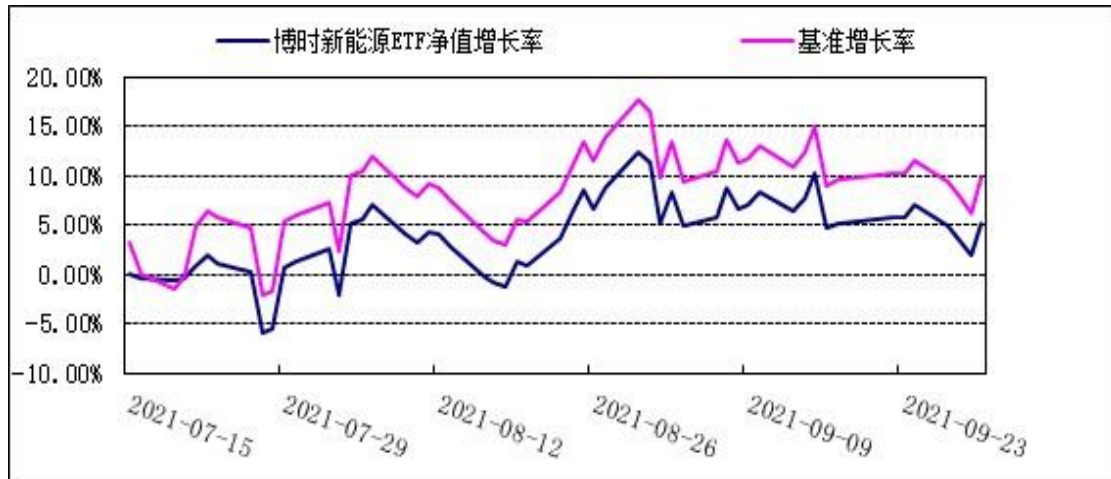
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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
自基金合同生 效起至今	5.28%	2.57%	9.77%	2.81%	-4.49%	-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 2021 年 7 月 15 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。

## §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	2021-07-15	-	9.2	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—至今)、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—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—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—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—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—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—至今)、博时中证 5G 产业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2021 年 7 月 14 日—至今)、博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 7 月 15 日—至今)、博时中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 8 月 19 日—至今)、博时中证金融科技主题交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 9 月 24 日—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，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 10 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 年三季度，海外主要市场指数多数涨跌不大，标普 500 微涨 0.23%，纳斯达克微跌 0.38%，英国富时 100 上涨 0.70%，法国 CAC40 微涨 0.19%，德国 DAX 指数下跌 1.74%，日经 225 上涨 2.30%，而香港恒生指数受反垄断政策影响，下跌 14.75%。国内 A 股呈现机构性行情，中小盘风格表现较强，而核心资产与科技板块回调明显。汇率方面，美元兑人民币与二季度末几乎持平。债券市场方面，10 年期国债收益率下行 20 个 BP，9 月底收益率为 2.878%，美国债 10 年期收益率略有上升，9 月底为 1.520%，全球流动性仍处于宽松状态。展望 2021 年第四季度，宏观上，全球疫情反复而疫后刺激政策的逐步退潮，全球经济扩张动能环比有所放缓，短期韧性主要表现在出口与高端制造两个方面。通胀方面，四季度预计仍是维持 CPI 低位、PPI 高位，前三季度成本传导机制较为顺畅，但经济下行压力的明显加大，成本传导不畅，影响制造业盈利。货币政策方面，宽货币、稳信用是四季度货币政策的主基调，资金面将延续目前稳中偏松的基调。在能源革命、碳中和政策的大背景下，新能源板块长期趋势向好，特别是光伏领域，未来产业空间仍较广阔，短期关注景气波动风险。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 09 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.0528 元，份额累计净值为 1.0528 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 5.28%，同期业绩基准增长率为 9.77%。

#### 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	184,278,431.55	96.93
	其中：股票	184,278,431.55	96.93
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	5,425,278.80	2.85
8	其他各项资产	407,936.05	0.21
9	合计	190,111,646.40	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

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	167,417,394.35	89.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,701,164.00	6.77
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	-	-
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	488,785.20	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	182,988.00	0.10
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	3,487,320.00	1.86
	合计	184,277,651.55	98.27

## 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	32,675	17,178,227.75	9.16
2	601012	隆基股份	198,500	16,372,280.00	8.73
3	300274	阳光电源	65,808	9,764,591.04	5.21
4	600438	通威股份	174,200	8,873,748.00	4.73
5	002460	赣锋锂业	51,850	8,448,439.00	4.51
6	300014	亿纬锂能	73,100	7,239,093.00	3.86
7	002129	中环股份	136,900	6,279,603.00	3.35



8	603799	华友钴业	54,400	5,624,960.00	3.00
9	002709	天赐材料	36,500	5,552,380.00	2.96
10	300450	先导智能	60,500	4,224,110.00	2.25

#### 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华友钴业(603799)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2月10日，因信息披露虚假或严重误导性陈述,未及时披露公司重大事项,未依法履行其他职责等行为，上海证券交易所对浙江华友钴业股份有限公司处以监管关注措施。

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	362,010.70
2	应收证券清算款	2,028.86



3	应收股利	-
4	应收利息	1,565.01
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	42,331.48
8	其他	-
9	合计	407,936.05

#### 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

基金合同生效日基金份额总额	339,124,083.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	117,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	278,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	178,124,083.00

注：本基金的基金合同于 2021 年 7 月 15 日生效。

## §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 9 月 30 日，博时基金公司共管理 296 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 16138 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 4752 亿元人民币，累计分红逾 1509 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 9 月 28 日，由中国证券报社有限公司主办的第十八届中国基金业金牛奖评选结果正式揭晓，凭借出色的业绩以及卓越的投资实力，博时信用债纯债债券一举荣获了“五年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2021 年 9 月 27 日，由证券时报报社有限公司主办的第十六届中国基金业明星基金奖正式公布，凭借出色的业绩以及卓越的投资实力，博时天颐债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。

2021 年 9 月，由北京济安金信科技有限公司主办的第三届济安“群星汇”评选结果揭晓，凭借卓越的综合管理实力和旗下基金产品出色的长期业绩，博时基金一举获得了“济安众星奖”、“济安五星奖”两项重量级的公司奖项。博时旗下产品博时合惠货币（004841）获得了“基金产品单项奖-货币型”，博时合惠货币基金经理魏桢则荣获了“五星基金明星奖”奖。

2021 年 7 月 6 日，由上海证券报社有限公司主办的第十七届“金基金”奖的评选结果揭晓。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 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。

## §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

二〇二一年十月二十七日