

博时恒生科技交易型开放式指数证券投资
基金(QDII)
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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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	博时恒生科技 ETF(QDII)
场内简称	证券简称：恒指科技，扩位证券简称：恒生科技指数 ETF
基金主代码	159742
交易代码	159742
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 5 月 17 日
报告期末基金份额总额	352,928,292.00 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	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。2、债券和货币市场工具投资策略；3、金融衍生品投资策略；4、融资及转融通证券出借；5、资产支持证券的投资策略；6、存托凭证投资策略。 未来，随着投资工具的发展和丰富，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，即恒生科技指数收益率（经汇率调整后）。
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，跟踪恒生科技指数，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。此外，本基金可投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临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	中国民生银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	The Northern Trust Company
境外资产托管人中文名称	美国北美信托银行

§ 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	-1,948,906.18
2.本期利润	-19,544,058.31
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0694
4.期末基金资产净值	247,680,850.53
5.期末基金份额净值	0.7018

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	-8.82%	1.77%	-8.78%	1.77%	-0.04%	0.00%
过去六个月	-31.73%	2.27%	-31.67%	2.28%	-0.06%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-29.82%	2.10%	-26.22%	2.13%	-3.60%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来 基金累计份额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 5 月 17 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	说明
----	----	-----------------	----------	----

		任职日期	离任日期	年限	
万琼	基金经理	2021-05-17	-	14.8	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—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—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—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—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—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—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(2020 年 1 月 19 日—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—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—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—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—至今)、博时创业板指数证券投资基金(2021 年 4 月 2 日—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—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—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—至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021 年 12 月 21 日—至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021 年 12 月 28 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

市场回顾：2021 年四季度，欧美股市整体表现优异，标普 500 上涨 10.65%，纳斯达克上涨 8.28%，英国富时 100 上涨 4.21%，法国 CAC40 上涨 9.71%，德国 DAX 指数上涨 4.09%。亚太股市则出现一定程度调整，日经 225 下跌 2.24%，恒生指数下跌 4.79%。A 股主要指数普遍上涨，沪深 300 上涨 1.52%，中证 500 上涨 3.6%，创业板指上涨 2.4%。受互联网反垄断政策的影响，恒生科技指数四季度表现不佳，下跌 7.06%。展望 2022 年一季度，宏观上，Omicron 高传播性叠加圣诞出行，海外新增病例急升，经济复苏担忧再起。考虑到疫苗接种率的提升，以及全球各国应对疫情积累了足够经验，我们认为疫情总体仍在可控范围内。海外流动性上，美联储 Taper 靴子落地，市场加息预期升温，美国货币政策预计逐步正常化。国内经济方面，稳增长政策发力、流动性改善等因素保障经济平稳发展。通胀方面，终端消费回暖、猪价周期性回升，中国 CPI 中枢逐步上移，但总体可控。同时，全球供需缺口收窄，中国 PPI 将步入回落周期。对互联网平台公司的限制预计会成为未来一段时间常态化政策，但相关政策很难再边际收紧，恒生科技指数的政策底逐步出现。恒生科技指数当前估值已经处于历史较低位置，特别是指数内部分平台型龙头公司的估值处在历史低位，考虑到这批公司未来仍然受益于中国经济发展以及消费升级，成长前景虽然短期受挫，但长期仍然有空间。经过 2021 年的调整，我们认为 2022 年一季度恒生科技指数具有良好的配置价值。

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 0.7018 元，份额累计净值为 0.7018 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-8.82%，同期业绩基准增长率-8.78%。

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(人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----------	------------------

1	权益投资	239,345,279.12	95.21
	其中：普通股	239,345,279.12	95.21
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,206,211.42	4.46
8	其他各项资产	842,286.87	0.34
9	合计	251,393,777.41	100.00

注：金融衍生品投资项下的期货投资，在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货结算暂收款（结算所得的持仓损益）相抵消后的净额为 0，具体投资情况详见下表：

期货类型	期货代码	期货名称	持仓量(买/卖)	合约价值 (人民币元)	公允价值变动 (人民币元)
股指期货	HCTH2	HSTECH Futures Mar22	31.00	7,255,178.00	268,172.80
总额合计					268,172.80
减：可抵消期货暂收款					268,172.80
股指期货投资净额					-

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
中国香港	239,345,279.12	96.63
合计	239,345,279.12	96.63

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	78,346,028.21	31.63
医疗保健	5,664,038.46	2.29
金融	2,667,697.98	1.08
信息技术	88,984,926.82	35.93

电信业务	63,682,587.65	25.71
合计	239,345,279.12	96.63

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技	2382 HK	中国香港证券交易所	中国香港	105,600.00	21,291,088.90	8.60
2	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	中国香港证券交易所	中国香港	54,200.00	20,242,598.66	8.17
3	XIAOMI CORP-CLASS B	小米集团	1810 HK	中国香港证券交易所	中国香港	1,291,400.00	19,955,539.30	8.06
4	MEITUAN-CLASS B	美团	3690 HK	中国香港证券交易所	中国香港	104,600.00	19,276,424.38	7.78
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	阿里巴巴	9988 HK	中国香港证券交易所	中国香港	195,600.00	19,014,792.38	7.68
6	KUAISHOU TECHNOLOGY	快手	1024 HK	中国香港证券交易所	中国香港	293,100.00	17,265,958.25	6.97
7	JD.COM INC - CL A	京东集团	9618 HK	中国香港证券交易所	中国香港	73,300.00	16,420,841.92	6.63
8	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	中芯国际	981 HK	中国香港证券交易所	中国香港	758,500.00	11,571,991.54	4.67
9	NETEASE INC	网易	9999 HK	中国香港证券交易所	中国香港	86,900.00	11,190,286.80	4.52
10	HAIER SMART HOME CO LTD-H	海尔智家	6690 HK	中国香港证券交易所	中国香港	405,600.00	10,926,831.55	4.41

注：所用证券代码采用当地市场代码。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产 净值比例(%)
1	期货	HSTECH Futures Mar22	268,172.80	0.11

5.9 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基金投资明细

本基金本期末未持有基金投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除美团(3690 HK)、阿里巴巴(9988 HK)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8日，因存在限制平台内经营者与其他竞争性平台合作等行为，国家市场监督管理总局对美团处以责令停止违法行为、罚款的行政处罚。

主要违规事实：2021年4月10日，因阿里巴巴集团控股有限公司存在滥用其在中国境内网络零售平台服务市场的支配地位，禁止平台内经营者在其他竞争性平台开店或者参加促销活动，排除、限制了相关市场竞争，侵害了平台内经营者的合法权益，损害了消费者利益，阻碍了平台经济创新发展，且不具有正当理由，构成《反垄断法》第十七条第一款第(四)项禁止“没有正当理由，限定交易相对人只能与其进行交易”的滥用市场支配地位行为，市场监管总局对阿里巴巴集团控股有限公司处以责令停止违法行为、罚款的行政处罚。。

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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	841,982.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	304.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	842,286.87

5.10.4 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。

5.10.5 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。

5.10.6 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

报告期期初基金份额总额	251,928,292.00
报告期期间基金总申购份额	101,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	352,928,292.00

§ 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 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恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)设立的文件

9.1.2 《博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》

9.1.3 《博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)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 报告期内博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)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