

# 博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金

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	博时沪深 300 指数增强
基金主代码	010872
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 30 日
报告期末基金份额总额	39,420,594.69 份
投资目标	本基金通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，在对标的指数有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.50%，年跟踪误差不超过 7.5%。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。1、股票投资策略（指数化投资策略、投资组合构建和优化、指数增强策略、股票组合调整、港股投资策略、存托凭证投资策略）；2、债券投资策略；3、衍生产品投资策略（股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略）；4、资产支持证券投资策略；5、融资及转融通证券出借业务投资策略
业绩比较基准	沪深 300 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，跟踪沪深 300 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	博时沪深 300 指数增强 A	博时沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	010872	010873
报告期末下属分级基金的份额总额	31,658,103.13 份	7,762,491.56 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 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)	
	博时沪深 300 指数增强 A	博时沪深 300 指数增强 C
1.本期已实现收益	-1,846,543.55	-447,647.59
2.本期利润	-937,564.51	-208,078.12
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0303	-0.0279
4.期末基金资产净值	27,245,689.06	6,660,354.07
5.期末基金份额净值	0.8606	0.8580

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. 博时沪深300指数增强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
过去三个月	-3.48%	0.71%	1.46%	0.75%	-4.94%	-0.04%
过去六个月	-11.36%	0.96%	-5.13%	0.97%	-6.23%	-0.01%
过去一年	-13.87%	1.13%	-4.85%	1.11%	-9.02%	0.02%
自基金合同 生效起至今	-13.94%	1.13%	-1.84%	1.12%	-12.10%	0.01%

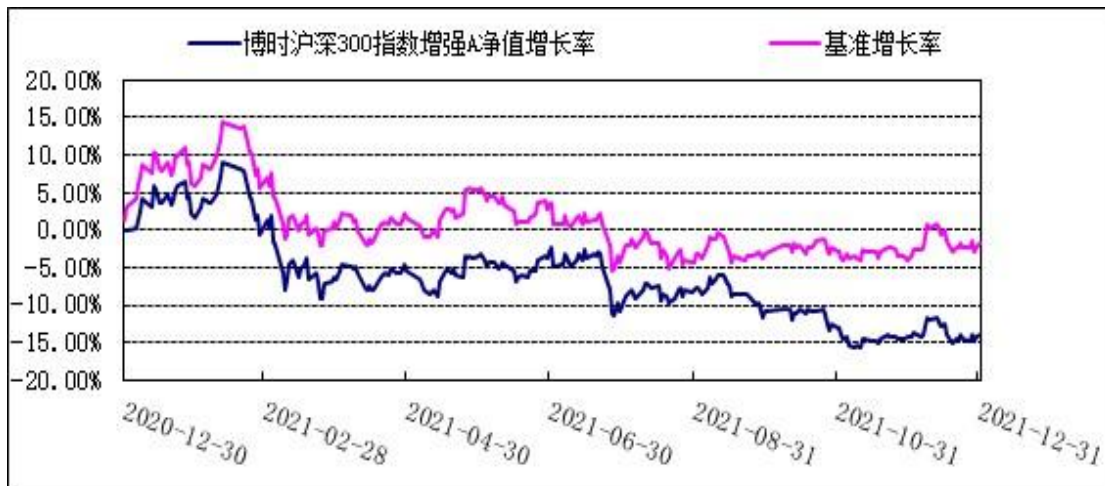
###### 2. 博时沪深300指数增强C:

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
过去三个月	-3.54%	0.71%	1.46%	0.75%	-5.00%	-0.04%

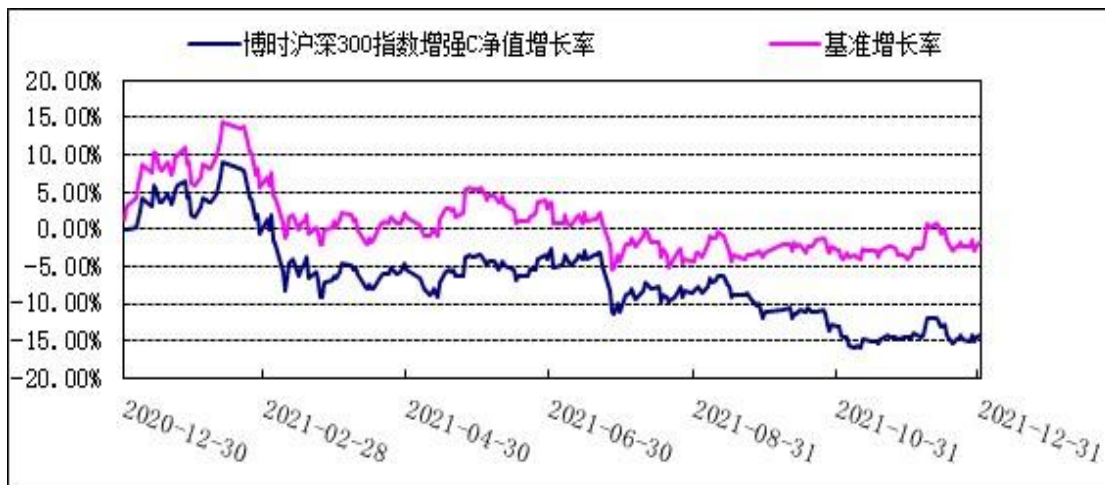
过去六个月	-11.50%	0.95%	-5.13%	0.97%	-6.37%	-0.02%
过去一年	-14.13%	1.13%	-4.85%	1.11%	-9.28%	0.02%
自基金合同生效起至今	-14.20%	1.13%	-1.84%	1.12%	-12.36%	0.01%

### 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. 博时沪深300指数增强A:



#### 2. 博时沪深300指数增强C:



注：本基金的基金合同于 2020 年 12 月 30 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		

桂征辉	指数与量化 投资部投资 副总监/基 金经理	2020-12-30	-	12.3	桂征辉先生，硕士。2006 年起先后在松下电器、美国在线公司、百度公司工作。2009 年加入博时基金管理有限公司。历任高级程序员、高级研究员、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2018 年 6 月 12 日-2019 年 9 月 5 日)、博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2017 年 9 月 26 日-2020 年 12 月 23 日)、博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金(2016 年 5 月 20 日-2021 年 7 月 16 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2015 年 7 月 21 日—至今)、博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2015 年 7 月 21 日—至今)、博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日—至今)的基金经理。
刘钊	指数与量化 投资部投资 副总监/基 金经理	2020-12-30	-	15.3	刘钊先生，博士。2006 年起先后在深圳证券交易所、五矿证券、摩根士丹利华鑫基金、深圳知方石投资有限公司工作。2020 年加入博时基金管理有限公司。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2020 年 12 月 23 日—至今)、博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日—至今)、博时智选量化多因子股票型证券投资基金(2021 年 11 月 2 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，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

投资策略与运作分析： 本季度市场风格变化较大，以煤炭为代表的周期行业在政策影响下有所回撤，季度末以新能源车为代表的成长股跑输价值股等。报告期内本基金按照量化模型进行管理，在较为密切跟踪基准指数的基础上根据模型打分选股。展望 2022 年，宏观政策逐步宽松，稳增长成为政策的主线。经过 2021 年的整固，沪深 300 指数整体估值不高，未来可能机会大于风险。同时居民资产配置向权益转移是未来持续的趋势，在资金面上有足够的支持。同时沪深 300 指数在业绩增长上可能相对占优，相对全市场表现可能会更好。本基金采用量化模型进行风险控制下的股票优选，力争获得超越沪深 300 指数基准的超额收益，长期来看具有较好的投资价值。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 0.8606 元，份额累计净值为 0.8606 元，本基金 C 类基金份额净值为 0.8580 元，份额累计净值为 0.8580 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 -3.48%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 -3.54%，同期业绩基准增长率为 1.46%。

### 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	31,427,910.41	91.92



	其中：股票	31,427,910.41	91.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	31,000.20	0.09
	其中：债券	31,000.20	0.09
	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	2,590,692.07	7.58
8	其他各项资产	142,471.00	0.42
9	合计	34,192,073.68	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	38,504.00	0.11
B	采矿业	1,765,860.00	5.21
C	制造业	19,709,490.50	58.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	133,290.00	0.39
E	建筑业	420,762.00	1.24
F	批发和零售业	34,892.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	667,909.50	1.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,532,043.01	4.52
J	金融业	5,219,427.40	15.39
K	房地产业	245,785.00	0.72
L	租赁和商务服务业	242,278.00	0.71
M	科学研究和技术服务业	968,545.00	2.86
N	水利、环境和公共设施管理业	2,911.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	18,078.00	0.05
Q	卫生和社会工作	372,162.00	1.10
R	文化、体育和娱乐业	40,322.00	0.12
S	综合	15,651.00	0.05
	合计	31,427,910.41	92.69

## 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	600519	贵州茅台	400	820,000.00	2.42
2	601166	兴业银行	34,800	662,592.00	1.95
3	601728	中国电信	151,543	647,088.61	1.91

4	600887	伊利股份	13,900	576,294.00	1.70
5	000858	五粮液	2,300	512,118.00	1.51
6	000651	格力电器	13,600	503,608.00	1.49
7	603986	兆易创新	2,800	492,380.00	1.45
8	300750	宁德时代	800	470,400.00	1.39
9	600183	生益科技	19,500	459,225.00	1.35
10	300760	迈瑞医疗	1,200	456,960.00	1.35

#### 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	1,000.20	0.00
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）	30,000.00	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	31,000.20	0.09

#### 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	113052	兴业转债	300	30,000.00	0.09
2	019649	21 国债 01	10	1,000.20	0.00

#### 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兴业银行(601166)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 8 月 5 日，因存在 1.违规办理内保外贷业务 2.未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料 3.违反外汇市场交易管理规定 4.未按规定保存交易通讯记录 5.违规办理银行卡业务的违规行为，国家外汇管理局福建省分局对兴业银行股份有限公司处以罚款等行政处罚。2021 年 8 月 20 日，因存在违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定的违规行为，中国人民银行对兴业银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

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。

**5.11.2 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	5,493.65
2	应收证券清算款	84,505.12
3	应收股利	-
4	应收利息	366.36
5	应收申购款	52,105.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	142,471.00

#### 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	601728	中国电信	647,088.61	1.91	首次公开发行限售

#### 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	博时沪深300指数增强A	博时沪深300指数增强C
----	--------------	--------------

本报告期期初基金份额总额	30,139,260.73	5,412,807.74
报告期期间基金总申购份额	2,099,184.23	12,919,427.30
减：报告期期间基金总赎回份额	580,341.83	10,569,743.48
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	31,658,103.13	7,762,491.56

## §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

单位：份

项目	博时沪深300指数增强A	博时沪深300指数增强C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,450.05	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,450.05	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	25.37	-

### 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,450.05	25.37%	10,000,450.05	25.37%	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,450.05	25.37%	10,000,450.05	25.37%	-

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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	2021-10-01~2021-12-31	13,217,246.20	-	-	13,217,246.20	33.53%
	2	2021-10-01~2021-12-31	10,000,450.05	-	-	10,000,450.05	25.37%

#### 产品特有风险

本报告期内，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，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

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。

### 9.2 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。

## §10 备查文件目录

---

### 10.1 备查文件目录

- 10.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金设立的文件
- 10.1.2 《博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金基金合同》
- 10.1.3 《博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金托管协议》
- 10.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 10.1.5 报告期内博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 10.3 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