

博时恒生科技交易型开放式指数证券投资
基金(QDII)
2022 年第 1 季度报告
2022 年 3 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：二〇二二年四月二十二日

§ 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4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2022年1月1日起至3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 | 667,928,292.00 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 (2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日) |
|----------------|-----------------------------------------|
| 1.本期已实现收益 | -10,859,888.69 |
| 2.本期利润 | -49,042,092.98 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1025 |
| 4.期末基金资产净值 | 373,334,537.22 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.5589 |

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。

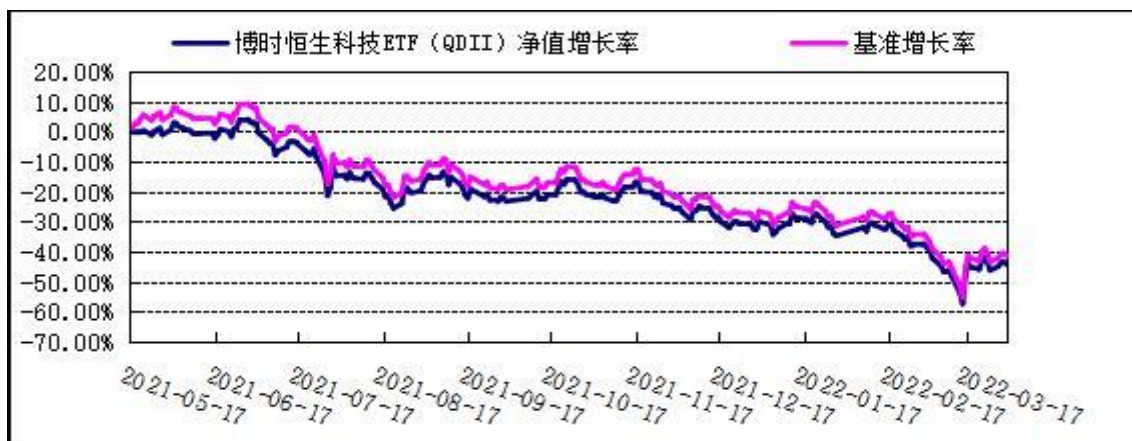
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | -20.36% | 4.32% | -20.27% | 4.34% | -0.09% | -0.02% |
| 过去六个月 | -27.39% | 3.26% | -27.27% | 3.27% | -0.12% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -44.11% | 2.86% | -41.18% | 2.89% | -2.93% | -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 年限 | 说明 |
|----|---------------------------------------------|-----------------|------|----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 万琼 | 指数与 量化投 资部投 资总监 助理/ 基金经 理 | 2021-05-17 | - | 15.0 | 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。现任指数与量化投资部投资总监助理兼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)、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)、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发起式联接基金(2022年1月10日—至今)、博时中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2022年3月3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合规守信情况说明

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，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。

4.4 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 6 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

2022 年一季度，受美联储加息及俄乌冲突引发的通胀预期影响，海外主要市场指数多数下跌，标普 500 下跌 4.95%，纳斯达克下跌 9.10%，法国 CAC40 下跌 6.89%，德国 DAX 指数下跌 9.25%，日经 225 下跌 3.37%，香港恒生指数下跌 5.99%，仅英国富时 100 指数上涨 1.78%。国内 A 股指数普遍下跌，价值风格表现占优，成长与科技板块表现较弱。汇率方面，美元兑人民币相比去年底跌 0.47%，人民币延续升值趋势。债券市场方面，10 年期国债收益率与去年底基本持平，3 月底收益率为 2.788%；美国债 10 年期收益率和去年底相比大幅上行 80 个 BP，3 月底收益率为 2.32%，全球流动性进入紧缩周期。展望 2022 年二季度，宏观上，海外方面，俄乌冲突对市场影响仍大，近期有整体向缓和发展的趋势，但即便情况缓解，海外通胀压力仍会处于高位，与此同时，美联储等央行收缩货币政策会导致流动性趋紧，增长预期预计也会趋于下降；国内方面，大概率将处于稳信用、宽货币和增长预期逐渐改善的状态，近期散发疫情对增长预期的冲击大概率已经过去。香港市场受益于国内政策面回暖，但基本面仍受宏观需求和海外风险偏好下行拖累。判断市场机会需紧扣稳增长政策下的企稳改善和上市公司的盈利预期变化，适当保持仓位的灵活性，把握结构性机会。风格上均衡配置大盘和中小盘。

截至 2022 年 03 月 31 日，本基金基金份额净值为 0.5589 元，份额累计净值为 0.5589 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-20.36%，同期业绩基准增长率-20.27%。

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 | 360,532,771.31 | 95.64 |
| | 其中：普通股 | 360,532,771.31 | 95.64 |
| | 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 | 13,309,673.22 | 3.53 |
| 8 | 其他各项资产 | 3,131,810.17 | 0.83 |
| 9 | 合计 | 376,974,254.70 | 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 | HCTM2 | HSTECH Futures Jun22 | 61.00 | 11,220,161.15 | 189,816.89 |
| 总额合计 | | | | | 189,816.89 |
| 减：可抵消期货暂收款 | | | | | 189,816.89 |
| 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 | 360,532,771.31 | 96.57 |
| 合计 | 360,532,771.31 | 96.57 |

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（%） |
|----------|----------------|--------------|
| 电信业务 | 98,729,473.46 | 26.45 |
| 非日常生活消费品 | 138,452,914.38 | 37.09 |
| 金融 | 4,553,829.26 | 1.22 |
| 信息技术 | 118,796,554.21 | 31.82 |
| 合计 | 360,532,771.31 | 96.57 |

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 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 阿里巴巴 | 9988 HK | 中国香港证券交易所 | 中国香港 | 388,500.00 | 35,320,174.86 | 9.46 |
| 2 | XIAOMI CORP-CLASS B | 小米集团 | 1810 HK | 中国香港证券交易所 | 中国香港 | 2,747,000.00 | 31,056,151.91 | 8.32 |
| 3 | MEITUAN-CLASS B | 美团 | 3690 HK | 中国香港证券交易所 | 中国香港 | 232,500.00 | 29,339,908.77 | 7.86 |
| 4 | TENCENT HOLDINGS LTD | 腾讯控股 | 700 HK | 中国香港证券交易所 | 中国香港 | 93,500.00 | 28,375,374.58 | 7.60 |
| 5 | KUAISHOU TECHNOLOGY | 快手 | 1024 HK | 中国香港证券交易所 | 中国香港 | 454,900.00 | 27,374,490.92 | 7.33 |
| 6 | JD.COM INC - CL A | 京东集团 | 9618 HK | 中国香港证券交易所 | 中国香港 | 140,080.00 | 26,583,869.71 | 7.12 |
| 7 | SUNNY OPTICAL TECH | 舜宇光学科技 | 2382 HK | 中国香港证券交易所 | 中国香港 | 211,200.00 | 21,599,077.84 | 5.79 |
| 8 | NETEASE INC | 网易 | 9999 HK | 中国香港证券交易所 | 中国香港 | 182,100.00 | 21,237,091.64 | 5.69 |
| 9 | SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | 中芯国际 | 981 HK | 中国香港证券交易所 | 中国香港 | 1,325,500.00 | 18,425,392.96 | 4.94 |
| 10 | LENOVO GROUP LTD | 联想集团 | 992 HK | 中国香港证券交易所 | 中国香港 | 2,140,000.00 | 14,786,983.13 | 3.96 |

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 | 期货投资 | HSTECH Futures Jun22 | 189,816.89 | 0.05 |

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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，腾讯控股有限公司在报告编制前一年受到市场监管总局的处罚。阿里巴巴集团控股有限公司在报告编制前一年受到市场监督管理总局的处罚。美团在报告编制前一年受到国家市场监督管理总局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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 | 3,131,810.17 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,131,810.17 |

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 | 352,928,292.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 336,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 21,000,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 667,928,292.00 |

§ 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 2022 年 3 月 31 日，博时基金公司共管理 322 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 15830 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 5144 亿元人民币，累计分红逾 1627 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 博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)各年度审计报告正本

9.1.6 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
二〇二二年四月二十二日