

博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金
2023 年第 2 季度报告
2023 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：渣打银行（中国）有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十一日

§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。

基金托管人渣打银行（中国）有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时 ESG 量化选股混合
基金主代码	018130
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 3 月 31 日
报告期末基金份额总额	339,308,429.83 份
投资目标	本基金通过量化模型精选 ESG 主题证券，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资策略分为大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、流通受限证券投资策略及参与融资业务的投资策略。 其中，大类资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，动态调整大类资产配置比例，以争取规避系统性风险。其次，股票投资策略在 ESG 主题的框架下以“量化投资”为主要投资策略，通过量化模型进行股票选择并构建股票投资组合。
业绩比较基准	中证 800ESG 基准指数收益率*75%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+中债综合财富（总值）指数收益率*20%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。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	渣打银行（中国）有限公司

下属分级基金的基金简称	博时 ESG 量化选股混合 A	博时 ESG 量化选股混合 C
下属分级基金的交易代码	018130	018131
报告期末下属分级基金的份额总额	231,894,319.44 份	107,414,110.39 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 (2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	博时 ESG 量化选股混合 A	博时 ESG 量化选股混合 C
1.本期已实现收益	-1,825,378.61	-1,002,197.05
2.本期利润	-7,433,833.78	-3,598,846.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0321	-0.0335
4.期末基金资产净值	224,462,616.38	103,816,250.95
5.期末基金份额净值	0.9680	0.9665

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（不包含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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ESG量化选股混合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	-3.20%	0.70%	-3.56%	0.63%	0.36%	0.07%
自基金合同 生效起至今	-3.20%	0.70%	-3.24%	0.63%	0.04%	0.07%

2. 博时ESG量化选股混合C:

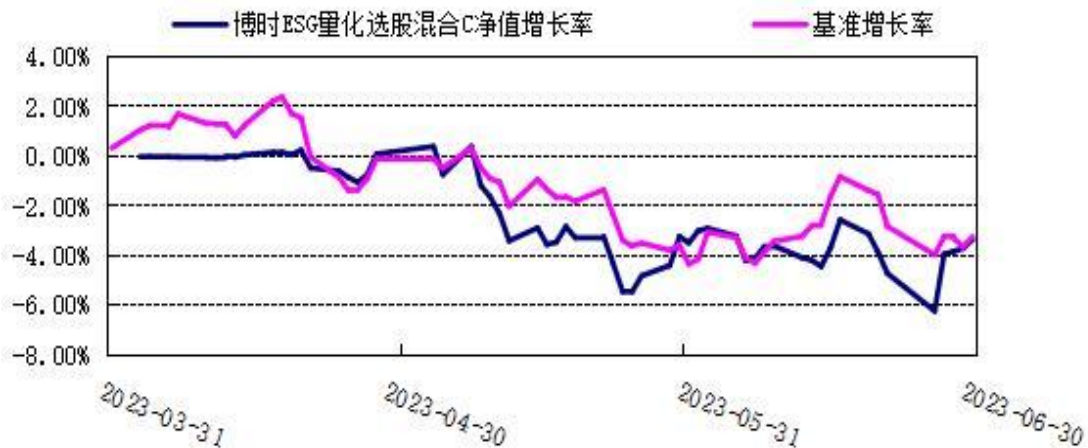
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.35%	0.70%	-3.56%	0.63%	0.21%	0.07%
自基金合同 生效起至今	-3.35%	0.70%	-3.24%	0.63%	-0.11%	0.07%

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ESG量化选股混合A:



2. 博时ESG量化选股混合C:



注：本基金的基金合同于 2023 年 3 月 31 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		
刘钊	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2023-03-31	-	16.8	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)、博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 2 月 13 日—至今)、博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金(2023 年 3 月 31 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遵规守信情况的说明

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 52 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

2023 年二季度，宏观层面，央行时隔 9 个月再度全面降息，市场对于经济刺激政策的讨论不绝于耳。虽然人民币汇率走低，部分北上资金持续减仓，但出口型制造业得到了有力的支持，上证指数呈现出底部企稳的迹象。

A 股结构性分化的情况仍在继续：计算机、传媒、通讯、电子等人工智能相关行业和央企主题相关个股走出宽幅震荡，先扬后抑，但整体上行；而消费者服务、食品饮料、房地产和 2021 年风光无限的电力设

备及新能源等行业则为负收益，资金场内博弈的态势得以延续。

从因子角度来看，二季度价值类因子仍维持上升通道；一季度表现不佳的成长、分析师等因子则扭转了下跌趋势，有所反弹；风险因子中的小市值等因子十分突出，延续了去年下半年以来的强趋势。在此背景下，本季度基金取得了正的超额收益。

展望三季度，随着市场炒作热度的降温，上市公司的股价终将回归基本面：相对景气的行业、有扎实的业绩增长的公司将会表现略好。特别是对于央企类相关主题，其业绩增速稳定、估值相对较低、机构资金不拥挤，有可能成为当季度资金的考虑对象，本基金也将给予重点关注。除此之外，本基金还将依靠量化多因子模型，紧扣相对偏成长的因子，构建投资组合，在坚持控制跟踪误差的基础上，适当暴露一定的行业偏离，根据模型结果配置股票组合，争取获得一定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 0.9680 元，份额累计净值为 0.9680 元，本基金 C 类基金份额净值为 0.9665 元，份额累计净值为 0.9665 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 -3.20%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 -3.35%，同期业绩基准增长率为 -3.56%。

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	291,394,088.09	88.62
	其中：股票	291,394,088.09	88.62
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	37,422,393.89	11.38
8	其他各项资产	-	-

9	合计	328,816,481.98	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	-	-
B	采矿业	31,295,245.00	9.53
C	制造业	146,106,956.24	44.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,867,967.00	3.01
E	建筑业	63,413,618.85	19.32
F	批发和零售业	4,700,487.00	1.43
G	交通运输、仓储和邮政业	8,940,349.00	2.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,932,144.00	6.68
J	金融业	4,478,586.00	1.36
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	658,735.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
	合计	291,394,088.09	88.76

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	002415	海康威视	439,700	14,558,467.00	4.43
2	601186	中国铁建	921,701	9,078,754.85	2.77
3	601390	中国中铁	1,186,500	8,993,670.00	2.74
4	601766	中国中车	1,369,930	8,904,545.00	2.71
5	601669	中国电建	1,535,000	8,810,900.00	2.68
6	601668	中国建筑	1,527,800	8,769,572.00	2.67
7	601857	中国石油	1,161,400	8,675,658.00	2.64
8	600050	中国联通	1,784,300	8,564,640.00	2.61
9	601800	中国交建	777,700	8,484,707.00	2.58
10	600028	中国石化	1,307,400	8,315,064.00	2.53

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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 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，中国建筑股份有限公司在报告编制前一年受到衡水市交通运输局、重庆市住房城乡建委的处罚。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。

5.11.2 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

本基金本报告期末未持有其他资产。

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ESG量化选股混合A	博时ESG量化选股混合C
本报告期期初基金份额总额	231,894,319.44	107,414,110.39
报告期期间基金总申购份额	-	-
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	-	-
本报告期期末基金份额总额	231,894,319.44	107,414,110.39

§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 2023 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 355 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 14767 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 5220 亿元人民币，累计分红逾 1851 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

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、报告期内博时 ESG 量化选股混合型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

二〇二三年七月二十一日