

**博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合
型证券投资基金
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：中国工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。

基金托管人中国工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	博时科创主题 3 年封闭混合
场内简称	科创投资 LOF
基金主代码	501082
交易代码	501082
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 27 日
报告期末基金份额总额	996,787,785.37 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以科创主题战略配售股票投资策略为主，并辅以科创主题相关股票一、二级市场投资策略和固定收益投资策略。本基金所界定的科技创新企业主要是指坚持面向世界科技前沿、面向经济主战场、面向国家重大需求，主要服务于符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业。重点支持新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业。其他投资策略包括：大类资产配置策略、股票资产的灵活配置策略、股票投资策略、固定收益投资策略、股指期货、国债期货投资策略、为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本基金可参与融资业务。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×50%+中证港股通综合指数（人民币）×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金与货币

	市场型基金，低于股票型基金。本基金以投资科创主题战略配售股票为主要投资策略，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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10月1日-2021年12月31日)
1.本期已实现收益	41,518,123.90
2.本期利润	73,445,637.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.0737
4.期末基金资产净值	2,204,769,451.03
5.期末基金份额净值	2.2119

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。

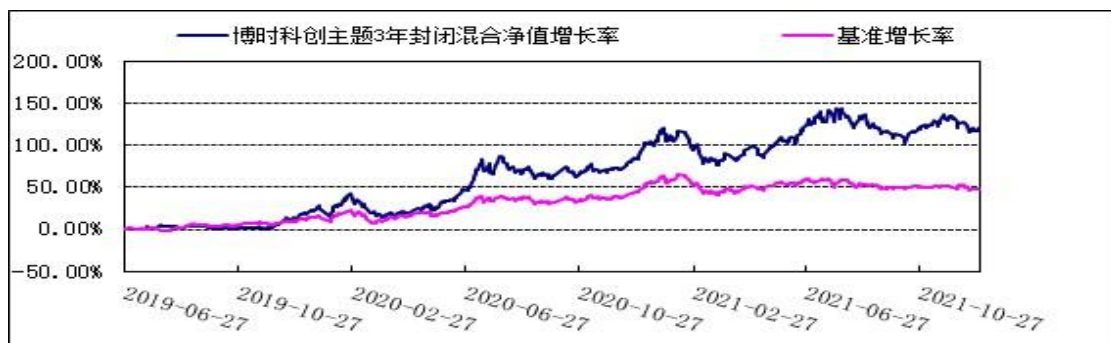
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	3.45%	1.35%	-0.90%	0.61%	4.35%	0.74%
过去六个月	-3.89%	1.69%	-7.03%	0.85%	3.14%	0.84%
过去一年	15.22%	1.72%	0.51%	1.03%	14.71%	0.69%
自基金合同生效起至今	121.19%	1.68%	48.75%	0.99%	72.44%	0.69%

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



§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		
曾鹏	公司董事 总经理/权益投研一体化总监/ 权益投资四部投资总监/境外 投资部总经理/权益投资四部 总经理/基金经理	2019-06-27	-	16.8	曾鹏先生，硕士。2005年起先后在上投摩根基金、嘉实基金从事研究、投资工作。2012年加入博时基金管理有限公司。历任投资经理、博时灵活配置混合型证券投资基金(2015年2月9日-2016年4月25日)基金经理、权益投资主题组负责人、权益投资总部一体化投研总监。现任公司董事总经理兼权益投研一体化总监、权益投资四部总经理、权益投资四部投资总监、境外投资部总经理、博时新兴成长混合型证券投资基金(2013年1月18日—至今)、博时特许价值混合型证券投资基金(2018年6月21日—至今)、博时科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(2019年6月27日—至今)、博时科技创新混合型证券投资基金(2020年4月15日—至今)、博时新兴消费主题混合型证券投资基金(2021年1月20日—至今)、博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金(2021年1月20日—至今)、博时港股通领先趋势混合型证券投资基金(2021年2月9日—至今)、博时半导体主题混合型证券投资基金(2021年7月20日—至今)、博时消费创新混合型证券投资基金(2021年11月8日—至今)

					的基金经理。
肖瑾瑾	权益投资 四部投资 总监助理/ 基金经理	2019-06-27	-	9.4	<p>肖瑾瑾先生，硕士。2012 年从复旦大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员、高级研究员兼基金经理助理、资深研究员兼基金经理助理、博时灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 8 月 1 日-2018 年 3 月 9 日)、博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 1 月 5 日-2019 年 6 月 21 日)、博时特许价值混合型证券投资基金(2018 年 6 月 21 日-2021 年 4 月 13 日)、博时汇悦回报混合型证券投资基金(2020 年 2 月 20 日-2021 年 4 月 13 日)的基金经理、权益投资主题组投资总监助理、博时消费创新混合型证券投资基金(2020 年 10 月 23 日-2021 年 11 月 8 日)、博时创业板两年定期开放混合型证券投资基金(2020 年 9 月 3 日-2021 年 12 月 14 日)的基金经理。现任权益投资四部投资总监助理兼博时回报灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 8 月 14 日—至今)、博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(2019 年 6 月 27 日—至今)、博时科技创新混合型证券投资基金(2020 年 4 月 15 日—至今)、博时科创板三年定期开放混合型证券投资基金(2020 年 7 月 29 日—至今)、博时创新精选混合型证券投资基金(2021 年 3 月 9 日—至今)、博时数字经济 18 个月封闭运作混合型证券投资基金(2021 年 6 月 18 日—至今)、博时半导体主题混合</p>

					型证券投资基金(2021 年 7 月 20 日—至今)、博时成长回报混合型证券投资基金(2021 年 12 月 3 日—至今)、博时时代消费混合型证券投资基金(2021 年 12 月 21 日—至今)的基金经理。
黄继晨	行业研究部总经理助理/基金经理	2020-11-04	-	7.5	黄继晨先生，硕士。2010 年至 2014 年先后在港铁轨道（深圳）有限公司、联讯证券工作。2016 年从南开大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员兼基金经理助理、研究部总经理助理。现任行业研究部总经理助理兼博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(2020 年 11 月 4 日—至今)、博时荣丰回报三年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(2021 年 9 月 7 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

2021 年第四季度，全球科技创新呈现加速迹象，我们看到越来越多的智能化汽车和元宇宙应用发布并将于 22 年走向量产。因此，我们认为 2022-23 年是全球科技创新大年，技术进步将推动新型硬件和算力（含科技基础设施）快速普及，这将给整条供应链带来新一轮投资机会。基于此我们对组合做出如下调整：1）坚守科技创新产业，增配景气上行的消费电子零部件产业链和数通产业链；减仓芯片设计和半导体设备板块。2）新能源板块持仓进一步向资源获取能力强的龙头集中。3）继续持有竞争格局开始改善的非制造业子行业，如：电商快递业。最后，展望 2022 年，我们对 A 股市场整体呈乐观看法。不同于 2021 年高度结构分化的投资局面，我们预计 2022 年 A 股市场将延续 2021 年 4 季度的“再均衡”风格。传统经济方面，房地产信用违约风险陆续兑现，国内金融系统的信用风险处置将告一段落，房地产驱动的相关产业链条也有望得到修复。新经济方面，科技创新和碳中和已成为经济转型升级的重要支柱，部分子行业估值虽然偏高，但基本面趋势和成长空间确定，投资周期上需要以时间换空间。行业景气度方面，我们观察到汽车智能化、元宇宙应用、军工、半导体材料等行业在 2022 年仍处于向上周期，我们将在上述高景气产业方向上精选估值与成长匹配度高的标的进行投资，以争取获得合理的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 2.2119 元，份额累计净值为 2.2119 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 3.45%，同期业绩基准增长率-0.90%。

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	1,979,359,819.48	88.29

	其中：股票	1,979,359,819.48	88.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	502,600.00	0.02
	其中：债券	502,600.00	0.02
	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	261,251,196.47	11.65
8	其他各项资产	854,109.73	0.04
9	合计	2,241,967,725.68	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 20,162,016.00 元，净值占比 0.91%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,758,963,666.11	79.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,092,669.78	1.09
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	133,211.54	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	28,786,344.00	1.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,587,213.55	2.57
J	金融业	32,151,547.35	1.46
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,575,430.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	22,021,396.18	1.00
N	水利、环境和公共设施管理业	14,899.39	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	30,848,550.00	1.40
S	综合	-	-
	合计	1,959,197,803.48	88.86

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	20,162,016.00	0.91
合计	20,162,016.00	0.91

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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	002475	立讯精密	2,873,227	141,362,768.40	6.41
2	300750	宁德时代	219,788	129,235,344.00	5.86
3	603501	韦尔股份	306,400	95,219,928.00	4.32
4	300782	卓胜微	231,270	75,579,036.00	3.43
5	601012	隆基股份	776,320	66,918,784.00	3.04
6	002409	雅克科技	763,113	61,941,882.21	2.81
7	300502	新易盛	1,568,880	61,468,718.40	2.79
8	601865	福莱特	967,400	56,051,156.00	2.54
9	002384	东山精密	2,025,600	54,893,760.00	2.49
10	603799	华友钴业	460,037	50,746,681.47	2.30

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	-	-
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）	502,600.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	502,600.00	0.02

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	113635	升 21 转债	3,590	502,600.00	0.02

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雅克科技（002409）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3月6日，因向海关申报进口一般贸易项下进口玻璃纤维毡时申报商品编号及适用税率不符合海关监管规定，中华人民共和国洋山海关对江苏雅克科技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	818,517.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	35,592.45
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	854,109.73

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

本报告期期初基金份额总额	996,787,785.37
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	996,787,785.37

§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份额。

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

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	327,237,599.48	-	1,182,500.00	326,055,099.48	32.71%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>							

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。

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科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 9.1.2 《博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型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 博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 9.1.6 报告期内博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置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

二〇二二年一月二十四日