

博时科创板三年定期开放混合型证券投资 基金

2023 年中期报告
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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
7.6 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	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	41
7.8 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贵金属投资明细	41
7.9 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	41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41

7.12 投资组合报告附注	41
§ 8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末上市基金前十名持有人	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	43
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件	47
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	48
11.1 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.....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时科创板三年定期开放混合型证券投资基金
基金简称	博时科创板三年定开混合
场内简称	证券简称：科创板 BS，扩位证券简称：科创板博时
基金主代码	506005
交易代码	506005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 29 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
报告期末基金份额总额	2,532,111,964.65 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 1 月 29 日

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，充分挖掘科创板所蕴含的投资机会，长期投资于科创板股票，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>（一）封闭期投资策略</p> <p>在封闭期内，本基金的投资策略包括：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、衍生产品投资策略、融资及转融通证券出借投资策略和流通受限证券投资策略等。本基金将通过系统和深入的基本面研究，密切关注科创板所蕴含的投资机会，长期投资于科创板股票，力争实现基金资产的长期稳健增值。封闭期投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生产品投资策略、融资及转融通证券出借投资策略、流通受限证券投资策略。</p> <p>本基金主要投向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、市场认可度高的科创板上市企业。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。本基金的股票投资策略包括科创板股票长期投资策略、战略配售投资策略、港股通标的股票投资策略、存托凭证投资策略等。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。</p>
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+中债综合财富（总值）指数收益率×30%
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。本基金以投资科创板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。本基金可投资港股通标的股票，

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，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	郭明
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		江向阳	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-105,216,744.21
本期利润	56,081,695.12
加权平均基金份额本期利润	0.0221
本期加权平均净值利润率	2.57%
本期基金份额净值增长率	2.76%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-494,533,277.37
期末可供分配基金份额利润	-0.1953
期末基金资产净值	2,089,938,626.91
期末基金份额净值	0.8254
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-13.35%

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。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

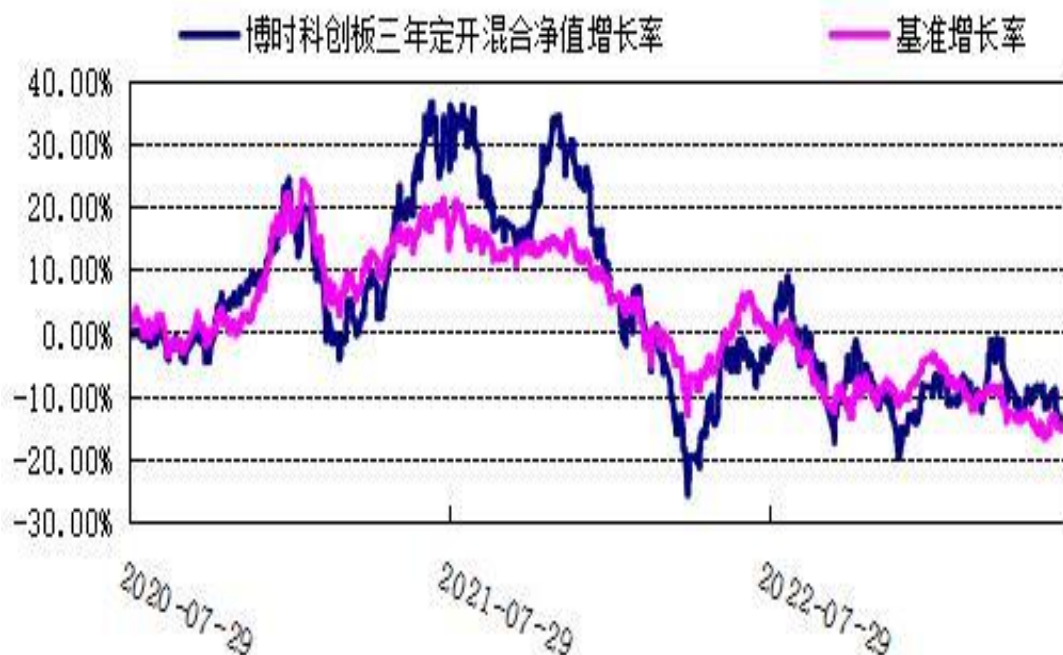
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-5.02%	1.22%	1.69%	0.88%	-6.71%	0.34%
过去三个月	-4.27%	1.60%	-5.40%	0.80%	1.13%	0.80%
过去六个月	2.76%	1.46%	-4.61%	0.75%	7.37%	0.71%
过去一年	-12.05%	1.67%	-18.68%	0.87%	6.63%	0.80%
自基金合同生效起至今	-13.35%	1.75%	-14.32%	1.04%	0.97%	0.71%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
肖瑾	权益投资四部投资总监助理 / 基金经理	2020-07-29	-	10.9	肖瑾先生，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日一至今)、博时科创主题灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2019年6月27日一至今)、博时科技创新混合型证券投资基金(2020年4月15日一至今)、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日一至今)、博时创新精选混合型证券投资基金(2021年3月9日一至今)、博时数字经济混合型证券投资基金(2021年6月18日一至今)、博时半导体主题混合型证券投资基金(2021年7月20日一至今)、博时成长回报混合型证券投资基金(2021年12月3日一至今)、博时时代消费混合型证券投资基金(2021年12月21日一至今)、博时回报严选混合型证券投资基金(2022年2月8日一至今)、博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金(2023年4月4日一至今)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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 89 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，A 股呈现出显著的结构分化特点，行业之间加速轮动，并欠缺持续性的投资机会。首先，市场指数层面表现平淡，投资者对经济复苏的预期快速变化导致顺周期方向的消费、建材、有色和金融等板块呈现宽幅波动；另一方面，人工智能技术创新驱动的通信、计算机、传媒和电子板块在经历一波上涨趋势后，多重因素导致投资者预期快速扭转，继而呈现大幅调整；此外，由于上半年权益市场整体资金流出，机构投资者配置较低的 A 股小盘风格显著强于大盘风格，同时境外投资者资金流出导致港股市场整体低迷。

宏观经济方面，我们认为美联储加息已进入尾声，国内逆周期调节政策将逐步发力。海外方面，美联储在 6 月暂停加息后，7 月下旬重新加息 25 个基点，美国二季度超预期的 GDP 增速和继续环比上升的核心 PCE 物价指数是推动重新加息的主要原因，但仔细分析发现美国上半年社会用电量和进口总额均呈现下降趋势，这表明美国实体经济仍处于下降通道，因此我们认为美联储本轮连续加息进程将宣告结束，美联储 9 月之后继续加息概率不大。国内方面，7 月下旬召开的中央政治局会议提升了投资者信心，会议指出“当前经济困难主要原因是国内需求不足，外部环境复杂严峻，下半年将精准有力实施宏观调控，加强逆周期调节和政策储备，保持人民币汇率稳定，扩大国内需求，适时调整优化房地产政策，活跃资本市场，提振投资者信心”，我们认为随着逆周期政策的推出，国内经济将在下半年逐步回升。最后，人工智能成为上半年资本市场共振的方向，以 GPU 芯片、AI 服务器为代表的算力需求持续走高，推动美股、A 股和中国台湾二级市场科技公司股价持续上涨，但 6 月下旬以来由于地缘政治影响，国内企业获取海外先进算力芯片的难度将加大，A 股市场人工智能板块率先开启回调。

流动性层面，今年上半年市场无风险利率整体下行，十年期国债期货价格上行。海外方面，由于美联储已经完成十一次加息，考虑到美国国内劳动力供给恢复和通胀数据的回落，我们预计美联储在 9 月下旬将完成最后 1 次加息，之后加息进程宣告结束，这将有利于新兴市场流动性恢复。国内方面，央行在 3 月中旬全面降准后，6 月份继续下调政策利率 10 个基点，叠加 6 月初银行存款利率调降，这将有效带动企业和居民实际贷款利率下行，当前政策目的是推升信贷需求，释放明确的稳增长信号，提振消费和投资信心；考虑到美联储加息临近终点，国内低通胀的经济环境也为后续的宽货币政策提供了客观条件，下半年降准仍有空间。最后，国内居民存量房贷的置换，地方债务一揽子方案的后续推出，都将引导国内实际贷款利率的持续下行，因此流动性层面我们预计下半年仍将延续过往的有利局面。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 0.8254 元，份额累计净值为 0.8821 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 2.76%，同期业绩基准增长率-4.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在分析宏观经济、流动性和基本面三大要素后，我们对 2023 年下半年市场维持结构性乐观看法。首先，我们认为人工智能技术将对全球经济增长形成重要推动力。当前海外人工智能技术正逐步进入企业领域，对存量企业的 AI 化改造即将开始，这将提升全要素劳动生产率。同时人工智能也在推动人形机器人、混合现实 MR 等硬件产品的进步，驱动新一轮技术革命到来。但我们也要清醒认识到国内企业相比美国科技巨头之间的差距和优劣势，大模型和算力底层是人工智能专用芯片，因此半导体国产化的重要性将更加凸显。其次，随着国内逆周期政策的推出，预计三季度开始国内经济复苏趋势将逐步明朗，国内制造业 PMI 和工业企业利润将探底回升。最后，地缘政治方面，我们预计中美关系将在下半年进入一段相对稳定的时期，这将有利于境外投资者信心的恢复。综上，我们认为下半年市场投资机会将较为均衡，除了产业趋势向上的人工智能行业，受益于总需求企稳回升的消费、建材、有色、金融以及部分周期品行业也有一定投资机会。

组合管理方面，在上述分析的基础上，组合的重点配置方向是半导体、医疗健康、计算机、合成生物学和消费电子行业。市场角度，2023 年一季度科创 50 指数表现较好，但二季度指数有所回落，科创板整体估值也呈现一定收缩，主要原因在于科创板指数中半导体和生物医药行业占比较高，对指数表现有所拖累。尽管如此，我们认为当下科创板整体价值重估进程仍将继续，指数中的半导体、生物医药、新能源、高端装备等行业三季度周期有较大概率见底回升。因此，本组合将继续围绕半导体、医疗健康、计算机、新能源、消费电子五大科创行业进行资产配置；2023 年上半年本组合减持了短期需求走弱的功率半导体和军工行业，增配了需求韧性较好的新能源光伏行业、与人工智能技术相结合的消费电子行业。展望 2023 年下半年，我们将紧密跟踪人工智能与消费电子终端创新的重要进展，并判断其对半导体、通信、消费电子、计算机等行业的需求拉动情况，前瞻性调整仓位，努力把握潜在的投资机遇。

风险层面，我们预计 2023 年下半年市场主要的风险因素集中在地缘政治和海外宏观层面。首先，西方发达国家的国债利率继续上行，已经导致不稳定因素显现，我们密切关注下半年潜在的宏观风险暴露事件对全球资产价格的冲击。其次，美国实体经济的恢复仍不理想，且核心物价指数仍处于环比增长通道，美国加息周期中的预期波动将对全球新兴市场国家资产价格构成不利影响。最后，全球化秩序的破碎和重构将是长期进程，这将导致全球供应链体系的失序和紊乱，影响全球商品供需平衡，并导致全球经济体系运行效率降低，全球经济复苏的节奏更为波折。这些将是我们下半年密切关注的主要风险因素。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——博时基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、

基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时科创板三年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	10,699,053.38	14,970,337.63
结算备付金		617,445.53	1,151,290.01
存出保证金		139,330.66	168,648.62
交易性金融资产	6.4.3.2	2,082,516,021.99	2,017,311,973.23
其中：股票投资		2,077,155,188.33	2,009,594,102.64
基金投资		-	-
债券投资		5,360,833.66	7,717,870.59
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-
应收清算款		-	4,064,712.88
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		2,093,971,851.56	2,037,666,962.37
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2023年6月30日	2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,652,723.41	2,671,053.05
应付托管费		442,120.55	445,175.53
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,113.80	45.83
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	933,266.89	693,756.17
负债合计		4,033,224.65	3,810,030.58
净资产：			
实收基金	6.4.3.8	2,532,111,964.65	2,532,111,964.65
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	-442,173,337.74	-498,255,032.86
净资产合计		2,089,938,626.91	2,033,856,931.79
负债和净资产总计		2,093,971,851.56	2,037,666,962.37

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8254 元，基金份额总额 2,532,111,964.65 份。

6.2 利润表

会计主体：博时科创板三年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
一、营业总收入		75,165,781.51	-655,885,088.22
1. 利息收入		206,186.89	126,627.58
其中：存款利息收入	6.4.3.10	54,771.98	126,627.58
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		151,414.91	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-86,338,844.71	-121,372,922.75
其中：股票投资收益	6.4.3.11	-93,943,696.25	-128,585,705.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	632,909.72	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	6,971,941.82	7,212,782.33
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	161,298,439.33	-534,638,793.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-	-
减：二、营业总支出		19,084,086.39	20,573,241.13
1. 管理人报酬		16,263,963.81	17,535,478.03
2. 托管费		2,710,660.67	2,922,579.70
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.3.18	-	-
7. 税金及附加		565.06	-
8. 其他费用	6.4.3.19	108,896.85	115,183.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		56,081,695.12	-676,458,329.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		56,081,695.12	-676,458,329.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		56,081,695.12	-676,458,329.35

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时科创板三年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	2,532,111,964.65	-	-498,255,032.86	2,033,856,931.79
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,532,111,964.65	-	-498,255,032.86	2,033,856,931.79
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	56,081,695.12	56,081,695.12
(一)、综合收益总额	-	-	56,081,695.12	56,081,695.12
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,532,111,964.65	-	-442,173,337.74	2,089,938,626.91
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	2,518,328,059.96	-	598,971,445.26	3,117,299,505.22
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,518,328,059.96	-	598,971,445.26	3,117,299,505.22
三、本期增减变动额	13,783,904.69	-	-754,799,288.28	-741,015,383

(减少以“-”号填列)				.59
(一)、综合收益总额	-	-	-676,458,329.35	-676,458,329.35
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	13,783,904.69	-	1,490,037.95	15,273,942.64
其中:1.基金申购款	13,783,904.69	-	1,490,037.95	15,273,942.64
2.基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-79,830,996.88	-79,830,996.88
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,532,111,964.65	-	-155,827,843.02	2,376,284,121.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：徐卫，会计机构负责人：佘方方

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增

增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	10,699,053.38

等于：本金	10,695,168.68
加：应计利息	3,884.70
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	10,699,053.38

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	2,026,861,35 1.71	-	2,077,155,188. 33	50,293,836.62	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	4,370,000.00	6,807.96	5,360,833.66	984,025.70
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,370,000.00	6,807.96	5,360,833.66	984,025.70
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	2,031,231,35 1.71	6,807.96	2,082,516,021. 99	51,277,862.32	

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.5 其他权益工具投资

6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	829,587.94
其中：交易所市场	829,587.94
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	103,678.95
合计	933,266.89

6.4.3.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,532,111,964.65	2,532,111,964.65
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,532,111,964.65	2,532,111,964.65

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

6.4.3.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-389,316,533.16	-108,938,499.70	-498,255,032.86
本期利润	-105,216,744.21	161,298,439.33	56,081,695.12
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-494,533,277.37	52,359,939.63	-442,173,337.74

6.4.3.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	44,040.03
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	9,608.61
其他	1,123.34
合计	54,771.98

6.4.3.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	915,595,707.12
减：卖出股票成本总额	1,007,047,641.27
减：交易费用	2,491,762.10
买卖股票差价收入	-93,943,696.25

6.4.3.12 债券投资收益

6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	5,535.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	627,374.31
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	632,909.72

6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,608,026.68
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,978,000.00
减：应计利息总额	2,508.94
减：交易费用	143.43
买卖债券差价收入	627,374.31

6.4.3.13 资产支持证券投资收益

6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.3.14 衍生工具收益

6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,971,941.82
其中：证券出借权益补偿收入	201,450.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,971,941.82

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	161,298,439.33
——股票投资	161,155,668.83
——债券投资	142,770.50
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	161,298,439.33

6.4.3.17 其他收入

无发生额。

6.4.3.18 信用减值损失

无。

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
中债登账户维护费	9,000.00
银行汇划费	717.90
合计	108,896.85

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	48,637,836.19	2.67%	-	-

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 债券交易

无。

6.4.6.1.4 债券回购交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	40,040.77	2.80%	20,823.85	2.51%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	16,263,963.81	17,535,478.03

其中：支付销售机构的客户维护费	3,194,887.56	3,334,426.86
-----------------	--------------	--------------

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,710,660.67	2,922,579.70

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	10,699,053.38	44,040.03	38,509,687.71	114,762.90

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期				
2023年1月1日至2023年6月30日				
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

				数量（单位： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	301123	奕东电子	网下发行	6,551.00	243,893.73
招商证券股份有限公司	001323	慕思股份	网下发行	573.00	22,306.89

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	首次公开发行限售	19.86	18.06	7,405.00	147,063.30	133,734.30	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	首次公开发行限售	11.10	17.04	6,261.00	69,497.10	106,687.44	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	首次公开发行限售	37.88	29.49	3,033.00	114,890.04	89,443.17	-
688307	中润光学	2023-02-08	6 个月	首次公开发行	23.88	31.73	2,455.00	58,625.40	77,897.15	-

				限售						
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	首次公开发售 限售	5.69	5.41	13,800.00	78,522.00	74,658.00	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	首次公开发售 限售	23.60	64.67	831.00	19,611.60	53,740.77	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	首次公开发售 限售	152.38	135.97	346.00	52,723.48	47,045.62	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	首次公开发售 限售	36.15	38.13	1,011.00	36,547.65	38,549.43	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	首次公开发售 限售	39.99	36.71	1,008.00	40,309.92	37,003.68	-
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月	首次公开发售 限售	6.58	7.58	4,016.00	26,425.28	30,441.28	-
688576	西山科技	2023-05-30	6 个月	首次公开发售 限售	135.80	120.41	240.00	32,592.00	28,898.40	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6 个月	首次公开发售 限售	12.10	12.07	2,361.00	28,568.10	28,497.27	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	首次公开发售 限售	26.74	40.68	648.00	17,327.52	26,360.64	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	首次公开发售 限售	21.17	23.50	956.00	20,238.52	22,466.00	-
688543	国科军工	2023-06-14	6 个月	首次公开发售 限售	43.67	53.05	410.00	17,904.70	21,750.50	-

688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月	首次公开发售	75.00	90.76	221.00	16,575.00	20,057.96	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	首次公开发售	125.80	118.03	163.00	20,505.40	19,238.89	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月	首次公开发售	32.52	42.37	402.00	13,073.04	17,032.74	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	首次公开发售	12.68	22.31	726.00	9,205.68	16,197.06	-
688334	西高院	2023-06-09	6 个月	首次公开发售	14.16	16.21	888.00	12,574.08	14,394.48	-
688593	新相微	2023-05-25	6 个月	首次公开发售	11.18	14.59	959.00	10,721.62	13,991.81	-
688512	慧智微	2023-05-08	6 个月	首次公开发售	20.92	19.16	721.00	15,083.32	13,814.36	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	首次公开发售	26.66	31.50	418.00	11,143.88	13,167.00	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月	首次公开发售	9.26	18.59	708.00	6,556.08	13,161.72	-
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月	首次公开发售	10.68	12.34	1,016.00	10,850.88	12,537.44	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	首次公开发售	21.86	23.85	472.00	10,317.92	11,257.20	-
60313	中重	2023-	6 个月	首次	17.80	17.89	628.00	11,17	11,23	-

5	科技	03-29		公开发 行限 售			0	8.40	4.92	
60106 5	江盐 集团	2023- 03-31	6 个月	首次 公开 发行 限 售	10.36	11.84	875.0 0	9,065 .00	10,36 0.00	-
68863 1	莱斯 信息	2023- 06-19	6 个月	首次 公开 发行 限 售	25.28	29.87	336.0 0	8,494 .08	10,03 6.32	-
68847 9	友车 科技	2023- 05-04	6 个月	首次 公开 发行 限 售	33.99	29.49	332.0 0	11,28 4.68	9,790 .68	-
68853 5	华海 诚科	2023- 03-28	6 个月	首次 公开 发行 限 售	35.00	51.23	161.0 0	5,635 .00	8,248 .03	-
60113 3	柏诚 股份	2023- 03-31	6 个月	首次 公开 发行 限 售	11.66	12.26	664.0 0	7,742 .24	8,140 .64	-
60312 5	常青 科技	2023- 03-30	6 个月	首次 公开 发行 限 售	25.98	24.53	160.0 0	4,156 .80	3,924 .80	-
60313 7	恒尚 节能	2023- 04-10	6 个月	首次 公开 发行 限 售	15.90	17.09	139.0 0	2,210 .10	2,375 .51	-
60317 2	万丰 股份	2023- 04-28	6 个月	首次 公开 发行 限 售	14.58	16.13	122.0 0	1,778 .76	1,967 .86	-

6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限 期	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：张)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
11803 6	力合 转债	2023- 06-29	15 个 交易 日	新债 未上 市	100.0 0	100.0 0	3,610 .00	361,0 00.00	361,0 07.12	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者,认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份,所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》,基金通过询价转让受让的股份,在受让后 6 个月内不得转让。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金参与网上申购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金以投资科创板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。本基金可投资港股通标的股票,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,本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的前提下,充分挖掘科创板所蕴含的投资机会,长期投资于科创板股票,力争实现基金资产的长期稳健增值。

本基金的基金管理人建立了董事会领导,以风险管理委员会为核心的,由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,董事会负责制定公司的风险管理政策,对风险管理负完全的和最终的责任;在董事会下设立风险管理委员会,负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别,以及负责解决重大的突发的风险;督察长独立行使督察权利,直接对董事会负责,向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议;监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察,并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助,使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标;风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程,组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作,确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各

种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	5,360,833.66	7,717,870.59
未评级	-	-
合计	5,360,833.66	7,717,870.59

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于开放期内要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

于本期末，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手

风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,699,053.38	-	-	-	10,699,053.38
结算备付金	617,445.53	-	-	-	617,445.53
存出保证金	139,330.66	-	-	-	139,330.66
交易性金融资产	-	-	5,360,833.66	2,077,155,188.33	2,082,516,021.99
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,455,829.57	-	5,360,833.66	2,077,155,188.33	2,093,971,851.56
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,652,723.41	2,652,723.41

应付托管费	-	-	-	442,120.55	442,120.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	5,113.80	5,113.80
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	933,266.89	933,266.89
负债总计	-	-	-	4,033,224.65	4,033,224.65
利率敏感度缺口	11,455,829.57	-	5,360,833.66	2,073,121.963.68	2,089,938.626.91
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,970,337.63	-	-	-	14,970,337.63
结算备付金	1,151,290.01	-	-	-	1,151,290.01
存出保证金	168,648.62	-	-	-	168,648.62
交易性金融资产	-	-	7,717,870.59	2,009,594,102.64	2,017,311,973.23
应收清算款	-	-	-	4,064,712.88	4,064,712.88
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,290,276.26	-	7,717,870.59	2,013,658,815.52	2,037,666,962.37
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,671,053.05	2,671,053.05
应付托管费	-	-	-	445,175.53	445,175.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	45.83	45.83
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	693,756.17	693,756.17
负债总计	-	-	-	3,810,030.58	3,810,030.58
利率敏感度缺口	16,290,276.26	-	7,717,870.59	2,009,848,784.94	2,033,856,931.79

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予

以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（不包括可转债和可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期：同）。

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,077,155,188.33	99.39	2,009,594,102.64	98.81
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	5,360,833.66	0.26	7,717,870.59	0.38
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,082,516,021.99	99.64	2,017,311,973.23	99.19

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注“衍生金融资产/负债”）。在当日无负债结算制度下，期货投资于相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵扣后的净额为 0。

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末	上年度末

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
业绩比较基准上升 5%	增加约 7,352	增加约 9,347
业绩比较基准下降 5%	减少约 7,352	减少约 9,347

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	2,081,106,911.80
第二层次	361,007.12
第三层次	1,048,103.07
合计	2,082,516,021.99

6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,077,155,188.33	99.20
	其中：股票	2,077,155,188.33	99.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,360,833.66	0.26
	其中：债券	5,360,833.66	0.26
	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	11,316,498.91	0.54
8	其他各项资产	139,330.66	0.01
9	合计	2,093,971,851.56	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	1,584,344,785.76	75.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	30,441.28	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	350,500,058.77	16.77
J	金融业	-	-
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	142,269,386.37	6.81
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	2,077,155,188.33	99.39

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	688036	传音控股	1,322,264	194,372,808.00	9.30
2	688639	华恒生物	1,744,673	157,858,013.04	7.55
3	688315	诺禾致源	3,802,955	100,968,455.25	4.83
4	688981	中芯国际	1,942,112	98,115,498.24	4.69
5	688536	思瑞浦	448,574	97,789,132.00	4.68
6	688019	安集科技	528,580	87,125,841.40	4.17
7	688596	正帆科技	1,984,611	85,933,656.30	4.11
8	688366	昊海生科	986,291	83,065,428.02	3.97
9	688120	华海清科	323,261	81,477,935.05	3.90
10	688385	复旦微电	1,489,196	74,608,719.60	3.57
11	688111	金山办公	141,382	66,763,408.04	3.19
12	688777	中控技术	987,712	62,008,559.36	2.97
13	688037	芯源微	349,262	59,706,338.90	2.86
14	688050	爱博医疗	285,747	58,672,431.51	2.81
15	688122	西部超导	953,051	53,113,532.23	2.54
16	688220	翱捷科技	655,580	49,424,176.20	2.36
17	688053	思科瑞	662,102	41,143,018.28	1.97
18	002881	美格智能	1,065,935	36,401,680.25	1.74
19	688200	华峰测控	232,165	35,521,245.00	1.70
20	688608	恒玄科技	265,454	32,127,897.62	1.54
21	688186	广大特材	950,112	30,907,143.36	1.48
22	688083	中望软件	205,163	29,726,067.07	1.42
23	688349	三一重能	852,209	27,458,173.98	1.31
24	688266	泽璟制药	503,662	23,445,466.10	1.12
25	688009	中国通号	3,784,074	21,947,629.20	1.05
26	688235	百济神州	186,372	20,335,048.92	0.97
27	688258	卓易信息	290,803	19,405,284.19	0.93
28	688048	长光华芯	193,689	18,307,484.28	0.88
29	688012	中微公司	114,566	17,923,850.70	0.86
30	688066	航天宏图	291,105	17,728,294.50	0.85
31	688072	拓荆科技	41,271	17,580,207.87	0.84
32	688502	茂莱光学	90,399	17,356,608.00	0.83
33	688661	和林微纳	236,312	16,612,733.60	0.79
34	688162	巨一科技	384,849	15,963,536.52	0.76
35	688561	奇安信	272,939	14,140,969.59	0.68

36	688110	东芯股份	372,653	13,452,773.30	0.64
37	688556	高测股份	235,690	12,524,566.60	0.60
38	688768	容知日新	145,262	11,602,075.94	0.56
39	688472	阿特斯	617,787	11,334,304.80	0.54
40	688800	瑞可达	179,665	11,166,179.75	0.53
41	688372	伟测科技	71,421	10,938,126.15	0.52
42	688503	聚和材料	107,610	10,491,975.00	0.50
43	688033	天宜上佳	547,824	10,474,394.88	0.50
44	688484	南芯科技	245,912	10,127,048.48	0.48
45	600353	旭光电子	1,170,320	9,596,624.00	0.46
46	688369	致远互联	171,816	9,501,424.80	0.45
47	688112	鼎阳科技	179,529	9,475,540.62	0.45
48	688212	澳华内镜	133,450	9,061,255.00	0.43
49	688321	微芯生物	393,646	8,912,145.44	0.43
50	688095	福昕软件	69,636	8,800,597.68	0.42
51	688252	天德钰	372,717	7,562,427.93	0.36
52	688045	必易微	131,425	7,491,225.00	0.36
53	688169	石头科技	20,135	6,456,891.80	0.31
54	688088	虹软科技	130,197	5,565,921.75	0.27
55	688097	博众精工	174,599	5,300,825.64	0.25
56	688586	江航装备	360,228	5,010,771.48	0.24
57	688025	杰普特	49,664	4,338,150.40	0.21
58	688569	铁科轨道	101,451	4,268,043.57	0.20
59	688589	力合微	95,296	3,882,359.04	0.19
60	688443	智翔金泰	30,329	933,162.53	0.04
61	688361	中科飞测	8,303	673,991.49	0.03
62	688147	微导纳米	6,293	332,144.54	0.02
63	688576	西山科技	2,395	315,642.70	0.02
64	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.01
65	688543	国科军工	4,094	228,607.10	0.01
66	688458	美芯晟	2,206	210,955.41	0.01
67	688581	安杰思	1,629	198,809.23	0.01
68	688478	晶升股份	4,013	188,591.35	0.01
69	688593	新相微	9,584	161,565.56	0.01
70	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.01
71	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.01
72	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.01
73	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
74	688523	航天环宇	4,717	125,405.25	0.01
75	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.01
76	688307	中润光学	2,455	77,897.15	0.00
77	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
78	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
79	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00

80	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
81	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
82	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
83	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
84	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
85	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
86	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
87	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
88	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
89	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
90	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
91	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
92	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
93	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688036	传音控股	155,580,977.48	7.65
2	688366	昊海生科	104,110,472.86	5.12
3	688981	中芯国际	98,101,227.92	4.82
4	688220	翱捷科技	49,323,982.81	2.43
5	688048	长光华芯	36,017,719.14	1.77
6	688502	茂莱光学	23,660,246.56	1.16
7	688009	中国通号	23,640,400.30	1.16
8	688235	百济神州	23,205,243.16	1.14
9	688266	泽璟制药	19,466,001.45	0.96
10	688066	航天宏图	19,431,989.99	0.96
11	688561	奇安信	18,833,864.14	0.93
12	688072	拓荆科技	18,063,028.72	0.89
13	688608	恒玄科技	16,762,174.96	0.82
14	688122	西部超导	14,816,458.08	0.73
15	600353	旭光电子	13,710,841.00	0.67
16	688556	高测股份	12,432,070.15	0.61
17	301308	江波龙	11,657,515.50	0.57
18	688472	阿特斯	11,597,691.37	0.57
19	688112	鼎阳科技	11,506,140.94	0.57
20	688484	南芯科技	11,403,279.46	0.56

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688187	时代电气	112,470,669.00	5.53
2	688383	新益昌	79,181,757.10	3.89
3	688518	联赢激光	76,939,912.48	3.78
4	688012	中微公司	35,673,152.38	1.75
5	688663	新风光	34,612,805.81	1.70
6	688567	孚能科技	32,903,106.34	1.62
7	688025	杰普特	32,818,887.97	1.61
8	688349	三一重能	28,020,149.57	1.38
9	688772	珠海冠宇	25,470,312.69	1.25
10	688120	华海清科	24,456,337.95	1.20
11	688008	澜起科技	24,410,460.93	1.20
12	688111	金山办公	23,004,437.09	1.13
13	688385	复旦微电	22,301,176.20	1.10
14	688190	云路股份	21,884,832.71	1.08
15	688248	南网科技	21,598,559.82	1.06
16	688048	长光华芯	21,347,100.82	1.05
17	688498	源杰科技	21,080,474.58	1.04
18	688033	天宜上佳	19,317,314.14	0.95
19	688234	天岳先进	17,670,318.52	0.87
20	688019	安集科技	17,207,904.45	0.85

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	913,453,058.13
卖出股票的收入（成交）总额	915,595,707.12

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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）	5,360,833.66	0.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,360,833.66	0.26

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	118023	广大转债	39,110	4,889,595.42	0.23
2	118036	力合转债	3,610	361,007.12	0.02
3	118031	天 23 转债	980	110,231.12	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制

日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	139,330.66
2	应收清算款	-
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	139,330.66

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	118023	广大转债	4,889,595.42	0.23

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例
61,022	41,495.07	240,380,723.14	9.49%	2,291,731,241.51	90.51%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿资产管理有限公司	168,226,308.00	15.45%
2	钱中明	51,358,233.00	4.72%
3	余子贵	45,631,472.00	4.19%
4	夏建	32,714,083.00	3.01%
5	方晨	24,241,409.00	2.23%
6	吴迅	14,684,383.00	1.35%
7	潘小彦	12,473,429.00	1.15%
8	周昭玲	12,167,193.00	1.12%
9	陈伟君	7,027,543.00	0.65%
10	张仲鑫	6,770,767.00	0.62%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，由于系统字数限制可能有持有人名称显示不全的情况，持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,178,593.62	0.13%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年7月29日）基金份额总额	2,509,679,843.79
本报告期期初基金份额总额	2,532,111,964.65

本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,532,111,964.65

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，邵凯先生离任公司副总经理，继续担任公司投资决策委员会委员。

基金管理人于 2023 年 5 月 27 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，孙献离任公司财务负责人；吴慧峰任公司副总经理、财务负责人。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起，聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国联证券	1	191,318,547.68	10.52%	139,911.12	9.78%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	73,909,305.81	4.06%	68,831.18	4.81%	增加 1 个
申万宏源	2	313,885,594.78	17.25%	262,672.93	18.37%	增加 1 个
中信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	2	880,171.96	0.05%	643.67	0.05%	-
南京证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	增加 1 个
广发证券	1	107,110,485.88	5.89%	99,751.82	6.97%	-
国元证	1	-	-	-	-	-

券						
华西证 券	3	165,693.56	0.01%	154.32	0.01%	-
长江证 券	1	36,054,604.03	1.98%	33,577.75	2.35%	-
宏信证 券	2	-	-	-	-	-
开源证 券	2	853,606,148.51	46.92%	624,240.66	43.65%	增加 1 个
招商证 券	3	48,637,836.19	2.67%	40,040.77	2.80%	-
中金公 司	2	94,094,545.71	5.17%	87,630.74	6.13%	-
兴业证 券	1	-	-	-	-	-
国金证 券	1	-	-	-	-	-
德邦证 券	1	-	-	-	-	-
光大证 券	2	-	-	-	-	增加 1 个
西部证 券	1	99,527,266.18	5.47%	72,783.17	5.09%	-
安信证 券	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

国联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	3,584,075.07	99.34%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	23,951.61	0.66%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230601	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01
2	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-27
3	博时科创板三年定期开放混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-22

4	博时科创板三年定期开放混合型证券投资基金 2022 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-30
5	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-18
6	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通兴业银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-13
7	博时科创板三年定期开放混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-20
8	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230104	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-04

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时科创板三年定期开放混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时科创板三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时科创板三年定期开放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、博时科创板三年定期开放混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时科创板三年定期开放混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 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
二〇二三年八月三十一日