

博时工业 4.0 主题股票型证券投资基金
2023 年第 4 季度报告
2023 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年一月二十二日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 1 月 18 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时工业 4.0 主题股票
基金主代码	002595
交易代码	002595
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 6 月 8 日
报告期末基金份额总额	25,824,582.15 份
投资目标	通过系统和深入的基本面研究，重点投资于工业 4.0 主题概念的优质上市公司，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产长期稳定增值。
投资策略	本基金主要投资策略是资产配置策略、股票投资策略和其他投资策略。资产配置策略是指本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析互相补充的方法，在股票、债券和现金等资产类之间进行相对稳定的适度配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。股票投资策略是本基金对于 4.0 主题所界定行业的上市公司，通过公司基本状况分析、股票估值分析进行个股精选。其他投资策略有债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证工业 4.0 指数*80%+中债综合指数*20%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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 (2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	-2,541,785.43
2.本期利润	-1,005,213.41
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0388
4.期末基金资产净值	41,851,887.39
5.期末基金份额净值	1.621

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

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	-2.29%	0.96%	-4.04%	1.00%	1.75%	-0.04%
过去六个月	-9.64%	0.91%	-12.45%	0.97%	2.81%	-0.06%
过去一年	-14.01%	0.94%	-4.62%	0.98%	-9.39%	-0.04%
过去三年	-31.40%	1.43%	-18.33%	1.24%	-13.07%	0.19%
过去五年	68.50%	1.50%	95.24%	1.40%	-26.74%	0.10%
自基金合同生 效起至今	62.10%	1.37%	31.78%	1.36%	30.32%	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



§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		
李喆	基金经理	2022-06-29	-	8.6	李喆先生，硕士。2014 年起先后在汇川技术有限责任公司、中投证券工作。2017 年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。现任博时逆向投资混合型证券投资基金(2020 年 10 月 28 日—至今)、博时先进制造混合型证券投资基金(2021 年 5 月 19 日—至今)、博时凤凰领航混合型证券投资基金(2021 年 9 月 22 日—至今)、博时高端装备混合型证券投资基金(2022 年 6 月 29 日—至今)、博时工业 4.0 主题股票型证券投资基金(2022 年 6 月 29 日—至今)的基金经理。
陈雷	基金经理	2023-03-08	-	15.4	陈雷先生，硕士。2007 年在华信惠悦咨询公司工作。2008 年加入博时基金管理

				有限公司。历任数据分析师、研究员、资深研究员、资深研究员兼基金经理助理、博时回报灵活配置混合型证券投资基金(2014 年 12 月 8 日-2016 年 4 月 20 日)、博时平衡配置混合型证券投资基金(2015 年 2 月 13 日-2016 年 4 月 20 日)、博时鑫禧灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 10 月 9 日-2018 年 9 月 27 日)的基金经理。现任博时行业轮动混合型证券投资基金(2014 年 8 月 29 日—至今)、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 3 月 10 日—至今)、博时高端装备混合型证券投资基金(2023 年 3 月 8 日—至今)、博时工业 4.0 主题股票型证券投资基金(2023 年 3 月 8 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，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 45 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

23 年 4 季度以来，A 股整体市场表现较为疲弱。地产、制造业和消费景气下行是主要拖累因素。在长期的房价预期被改变之后，地产面临持续的估值重估。制造业面临国内外产能过剩的风险。消费景气仍然平淡，结构差异较大，偏向性价比消费的趋势正在兴起。

行业方面：本基金偏好医药、农业养殖、计算机、传媒等行业。在需求稀缺的环境下，需求刚性的院内医药保持了不错的回升趋势。资金链紧张和生猪价格低迷使得生猪养殖行业面临产能的去化。而在 AI 大模型和多模态模型遍地开花的背景下，AI 行业应用的发展具备了更好的发展潜力，这将给 TMT 行业的相关公司带来投资机会。

报告期内，我们减持了食品行业的持仓，主要因为是在地产和制造业景气度持续下行的背景下，消费行业景气从 11 月开始出现环比下行；增持的主要行业是计算机、传媒、通信行业 AI 应用相关的公司，我们看好在 AI 大模型和多模态模型的持续发展下，AI 应用相关行业的投资机会。

当前市场的盈利预期受到国内和海外的双重不确定性的影响，本基金将对潜在的变化做积极应对。考虑到地产的预期已经处于较低水平，本基金也将审慎评估在潜在外生影响因素的影响下，景气逻辑变化的可能性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 1.621 元，份额累计净值为 1.621 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-2.29%，同期业绩基准增长率为-4.04%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在本报告期内出现连续了 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。针对该情形，本基金管理人已向中国证监会报告了解决方案。

§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	39,011,560.75	92.52
	其中：股票	39,011,560.75	92.52

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	3,093,056.65	7.34
8	其他各项资产	59,849.91	0.14
9	合计	42,164,467.31	100.00

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	9,286,575.00	22.19
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,250,634.01	38.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	732,600.00	1.75
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	6,988,214.74	16.70
J	金融业	815,724.00	1.95
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	1,641,255.00	3.92
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	412,962.00	0.99
R	文化、体育和娱乐业	2,883,596.00	6.89
S	综合	-	-
	合计	39,011,560.75	93.21

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	603477	巨星农牧	92,200	3,454,734.00	8.25
2	300498	温氏股份	159,600	3,201,576.00	7.65
3	600975	新五丰	251,700	2,630,265.00	6.28
4	002007	华兰生物	105,300	2,330,289.00	5.57
5	300081	恒信东方	142,100	1,641,255.00	3.92
6	300832	新产业	20,100	1,571,820.00	3.76
7	002152	广电运通	119,400	1,463,844.00	3.50
8	002100	天康生物	160,100	1,404,077.00	3.35
9	688016	心脉医疗	6,919	1,346,644.97	3.22
10	002901	大博医疗	32,900	1,335,411.00	3.19

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

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。

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	31,031.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	28,817.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	59,849.91

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	26,038,965.36
报告期期间基金总申购份额	588,411.48
减：报告期期间基金总赎回份额	802,794.69
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	25,824,582.15

§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 12 月 31 日,博时基金公司共管理 367 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 14668 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 5478 亿元人民币,累计分红逾 1936 亿元人民币,是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

§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工业 4.0 主题股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时工业 4.0 主题股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时工业 4.0 主题股票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、博时工业 4.0 主题股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时工业 4.0 主题股票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
二〇二四年一月二十二日