

博时专精特新主题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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	55
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.....	55
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.....	55
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.....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55

7.12 投资组合报告附注.....	55
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.3 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.....	57
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>57</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	59
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>60</b>
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.....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时专精特新主题混合型证券投资基金	
基金简称	博时专精特新主题混合	
基金主代码	014232	
交易代码	014232	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 6 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	655,517,444.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时专精特新主题混合 A	博时专精特新主题混合 C
下属分级基金的交易代码	014232	014233
报告期末下属分级基金的份额总额	360,122,878.99 份	295,394,565.62 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于专精特新主题的上市公司股票。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	<p>投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、其他资产投资策略三个部分内容。其中，资产配置策略即根据经济周期决定权益类证券和固定收益类证券的投资比例。其次，股票投资策略包括专精特新主题的界定、个股投资策略、港股通标的股票投资策略和存托凭证投资策略。其他资产投资策略有债券投资策略、金融衍生产品投资策略、资产支持证券投资策略、流通受限证券投资策略、参与融资业务投资策略等。专精特新主题相关上市公司根据工业和信息化部（以下简称“工信部”）发布《关于开展专精特新“小巨人”企业培育工作的通知》、《工业和信息化部关于促进中小企业“专精特新”发展的指导意见》的要求，优先聚焦制造业短板弱项，符合《工业“四基”发展目录》所列重点领域，从事细分产品市场属于制造业核心基础零部件、先进基础工艺和关键基础材料；或符合制造强国战略十大重点产业领域；或属于产业链供应链关键环节及关键领域“补短板”“锻长板”“填空白”产品；或围绕重点产业链开展关键基础技术和产品的产业化攻关；或属于新一代信息技术与实体经济深度融合的创新产品等范畴的相关上市公司。专精特新主题相关上市公司为工信部公示的专精特新“小巨人”名单中的上市企业及其更新。</p> <p>若未来由于技术进步或政策变化导致本基金专精特新主题相关领域和公司相关业务的覆盖范围发生变动，基金管理人在履行适当程序后有权对上述</p>

	定义进行补充和修订。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率（人民币）×10%+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。

## 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	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	姜敏
	联系电话	0755-83169999	4006800000
	电子邮箱	service@bosera.com	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		95105568	95558
传真		0755-83195140	010-85230024
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		518040	100020
法定代表人		江向阳	朱鹤新

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	博时基金管理有限公司	北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301

## § 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）	
	博时专精特新主题混合	博时专精特新主题混

	A	合 C
本期已实现收益	14,657,089.47	12,293,316.23
本期利润	40,887,348.48	33,188,833.44
加权平均基金份额本期利润	0.1115	0.1065
本期加权平均净值利润率	12.77%	12.27%
本期基金份额净值增长率	13.42%	13.14%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	博时专精特新主题混合 A	博时专精特新主题混 合 C
期末可供分配利润	-43,773,998.22	-37,881,381.75
期末可供分配基金份额利润	-0.1216	-0.1282
期末基金资产净值	327,886,523.35	266,854,980.74
期末基金份额净值	0.9105	0.9034
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	博时专精特新主题混合 A	博时专精特新主题混 合 C
基金份额累计净值增长率	-8.95%	-9.66%

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

#### 博时专精特新主题混合 A

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	3.75%	0.88%	1.81%	1.01%	1.94%	-0.13%
过去三个月	3.33%	0.94%	-6.52%	0.92%	9.85%	0.02%
过去六个月	13.42%	0.91%	-5.76%	0.87%	19.18%	0.04%
过去一年	-1.80%	1.04%	-21.97%	1.00%	20.17%	0.04%
自基金合同生效起至今	-8.95%	1.12%	-28.87%	1.16%	19.92%	-0.04%

#### 博时专精特新主题混合 C

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	3.71%	0.89%	1.81%	1.01%	1.90%	-0.12%



过去三个月	3.20%	0.94%	-6.52%	0.92%	9.72%	0.02%
过去六个月	13.14%	0.91%	-5.76%	0.87%	18.90%	0.04%
过去一年	-2.29%	1.04%	-21.97%	1.00%	19.68%	0.04%
自基金合同生效起至今	-9.66%	1.12%	-28.87%	1.16%	19.21%	-0.04%

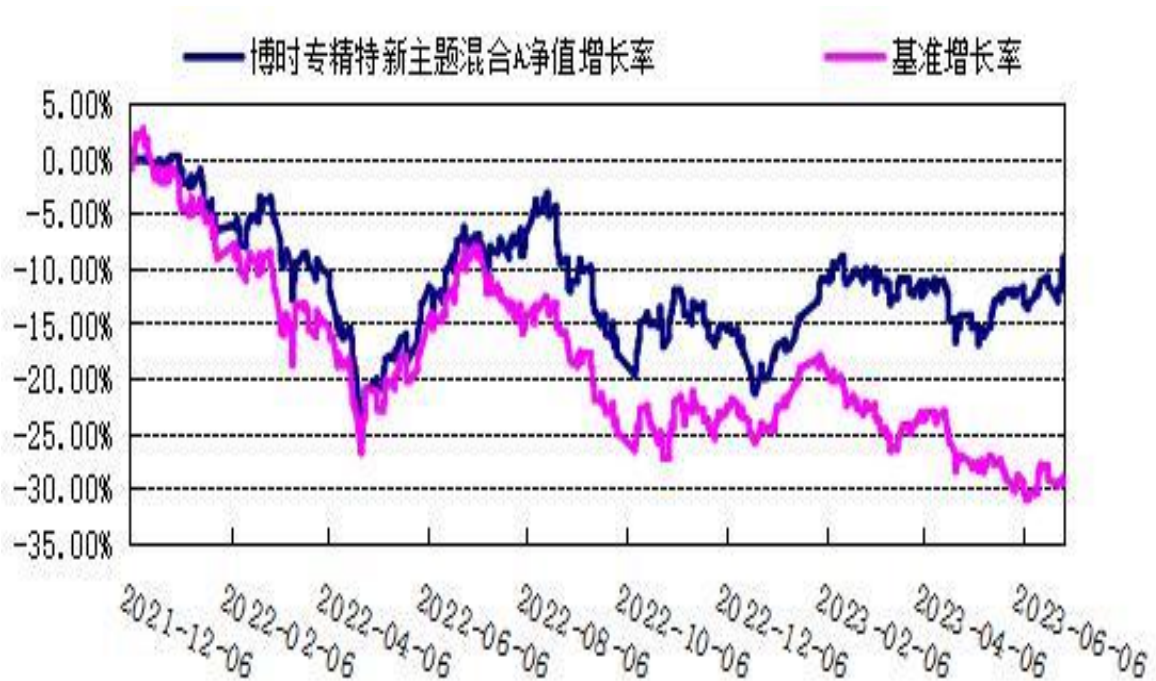
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时专精特新主题混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

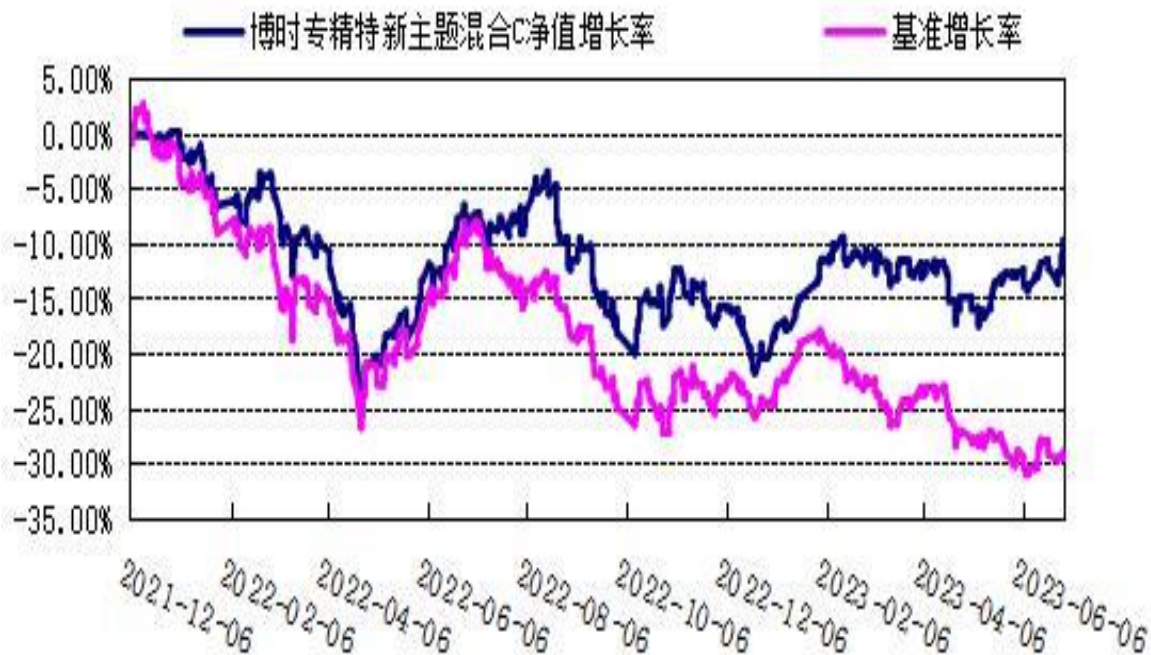
(2021 年 12 月 6 日至 2023 年 6 月 30 日)

#### 博时专精特新主题混合 A



#### 博时专精特新主题混合 C





## § 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		
郭晓林	权益投资四部 投资总监助理 /基金经理	2021-12-06	-	10.9	郭晓林先生，硕士。2012 年从清华大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司

					<p>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、资深研究员兼投资经理。现任权益投资四部投资总监助理兼博时汇悦回报混合型证券投资基金(2020年2月20日一至今)、博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金(2016年7月20日一至今)、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日一至今)、博时新能源汽车主题混合型证券投资基金(2021年6月2日一至今)、博时新能源主题混合型证券投资基金(2021年8月24日一至今)、博时移动互联主题混合型证券投资基金(2021年9月29日一至今)、博时专精特新主题混合型证券投资基金(2021年12月6日一至今)、博时凤凰领航混合型证券投资基金(2022年4月6日一至今)、博时优享回报混合型证券投资基金(2022年8月2日一至今)的基金经理。</p>
林景艺	基金经理	2022-02-28	2023-03-08	12.9	<p>林景艺女士，硕士。2010年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任量化分析师、高级研究员兼基金经理助理、博时国企改革主题股票型证券投资基金(2015年5月20日-2021年5月18日)、博时量化平衡混合型证券投资基金(2017年5月4日-2023年3月8日)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018年4月3日-2023年3月8日)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018年6月26日-2023年3月8日)、博时专</p>

					精特新主题混合型证券投资基金(2022年2月28日-2023年3月8日)的基金经理。
刘玉强	基金经理	2023-02-01	-	7.9	刘玉强先生，硕士。2015年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。曾任研究员、基金经理助理。现任博时专精特新主题混合型证券投资基金(2023年2月1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 股整体呈现先反弹后震荡的走势，1 月份各大宽基指数和风格指数均有较好表现，之后小市值、央企、一带一路、数字经济等主题轮番表现，随着 3 月中旬 GPT4 发布，AI 产

业催化密集，相关的 TMT 板块内部轮动切换，计算机、传媒、通信涨幅显著领先于其他板块。之后 AI 行情一波三折，在 4 月中上旬延续涨势后回调到 5 月底，6 月又经历了连续上涨后大幅下跌。在一些热门板块的回调过程中，小市值股票、专精特新类股票均有不错的相对表现，宁组合、茅指数则在 4 月、5 月继续下跌。风格方面，上半年还是以小为主，中证 1000、国证 2000 等小盘股指数表现好于沪深 300、上证 50 等大盘股指数；价值好于成长。行业上，不同产业链差异较大，AI 相关的通信、传媒、计算机领涨，顺周期行业多数下跌。

本基金是旗帜鲜明的专精特新主题基金，大部分非现金资产都投资于工信部公示的专精特新“小巨人”名单中的上市企业。我们采用定性和定量相结合的方法，在“小巨人”名单中选择行业景气度高、业绩成长性高且估值合理的标的进行配置，行业上配置相对均衡，在上半年行业轮动较快的环境中走势相对平稳，取得了一定涨幅。专精特新企业最大的特点是市值小，行业较为分散，还处于培育阶段，所以其公司的业务稳定度相比成熟的大企业有一定差距，连带着在股票市场上的表现就是波动会比较大，这也是投资专精特新首先需要重视的问题，但是这些公司盈利能力较强，成长空间也较大，有一定的投资价值。未来我们将会坚持寻找竞争优势明显、公司治理结构较好、财务质量较高、估值相对合理的专精特新“小巨人”上市公司，争取持续超越基准。

#### 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 A 类基金份额净值为 0.9105 元，份额累计净值为 0.9105 元，本基金 C 类基金份额净值为 0.9034 元，份额累计净值为 0.9034 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 13.42%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 13.14%，同期业绩基准增长率为-5.76%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，之前对于经济预期的反复，很大程度上导致了市场情绪的波动，但从各项数据看，国内基本面已呈现初步筑底的迹象，随着各项政策的逐步落地，市场对于经济的悲观预期将逐步修正，整体的市场情绪也有望修复；从海外看，来自美债利率上行、汇率贬值、外资流出的压力有望缓解；总体而言，我们看好下半年经济弱复苏，风险偏好也将在震荡与反复中逐步修复，未来机会或大于风险。

行业上继续关注景气反转与景气改善方向，随着经济重启，受益于经济周期性的复苏板块盈利端将大幅改善；同时 AI 技术创新对产业的拉动超出预期，算力端的需求爆发已经显著出现，同时 AI 作为生产力端的技术创新，将极大改变当前 B 端应用软件的生态，并且可能推动国内 B 端软件行业真正爆发。我们将密切跟踪基本面变化，挑选前景相对明确、估值和业绩匹配度较好的公司，找到 alpha 投资机会。

#### 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对博时专精特新主题混合型证券投资基金 2023 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。



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

本托管人认为，博时基金管理有限公司在博时专精特新主题混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人认为，博时基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2023 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

# § 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：博时专精特新主题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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	11,837,296.97	9,432,589.03
结算备付金		98,973,000.35	98,336,371.14
存出保证金		1,885,248.00	-
交易性金融资产	6.4.3.2	483,914,127.61	451,658,268.14
其中：股票投资		483,572,120.86	451,658,268.14
基金投资		-	-
债券投资		342,006.75	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		96,893.92	697,372.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		596,706,566.85	560,124,600.31
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
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		829,044.47	605,009.39
应付管理人报酬		716,707.44	733,617.66
应付托管费		119,451.26	122,269.61
应付销售服务费		106,957.29	113,194.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.23	0.65
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	192,902.07	180,011.88
负债合计		1,965,062.76	1,754,103.99
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.3.8	655,517,444.61	697,284,686.65
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	-60,775,940.52	-138,914,190.33
净资产合计		594,741,504.09	558,370,496.32
<b>负债和净资产总计</b>		<b>596,706,566.85</b>	<b>560,124,600.31</b>

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 655,517,444.61 份。其中 A 类基金份额净值 0.9105 元，基金份额总额 360,122,878.99 份；C 类基金份额净值 0.9034 元，基金份额总额 295,394,565.62 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时专精特新主题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 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
一、营业总收入		79,958,680.26	-70,436,371.52



1. 利息收入		860,243.87	1,664,618.72
其中：存款利息收入	6.4.3.10	860,243.87	1,664,618.72
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		31,941,143.20	-97,811,744.66
其中：股票投资收益	6.4.3.11	30,063,257.85	-101,760,828.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	6.54	-
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	-176,336.65	-
股利收益	6.4.3.15	2,054,215.46	3,949,083.87
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	47,125,776.22	25,476,974.58
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	31,516.97	233,779.84
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>5,882,498.34</b>	<b>7,738,488.11</b>
1. 管理人报酬		4,389,697.12	5,744,395.61
2. 托管费		731,616.19	957,399.22
3. 销售服务费		669,810.96	935,372.68
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		0.02	-
8. 其他费用	6.4.3.19	91,374.05	101,320.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>74,076,181.92</b>	<b>-78,174,859.63</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>74,076,181.92</b>	<b>-78,174,859.63</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>74,076,181.92</b>	<b>-78,174,859.63</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时专精特新主题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）	697,284,686.65	-	-138,914,190.33	558,370,496.32
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）	697,284,686.65	-	-138,914,190.33	558,370,496.32
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-41,767,242.04	-	78,138,249.81	36,371,007.77
（一）、综合收益总额	-	-	74,076,181.92	74,076,181.92
（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）	-41,767,242.04	-	4,062,067.89	-37,705,174.15
其中：1. 基金申购款	53,438,976.82	-	-7,880,569.31	45,558,407.51
2. 基金赎回款	-95,206,218.86	-	11,942,637.20	-83,263,581.66
（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）	655,517,444.61	-	-60,775,940.52	594,741,504.09
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）	901,352,308.88	-	2,189,525.27	903,541,834.15
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)	901,352,308.88	-	2,189,525.27	903,541,834.15
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-130,961,664.23	-	-59,245,882.23	-190,207,546.46
(一)、综合收益总额	-	-	-78,174,859.63	-78,174,859.63
(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)	-130,961,664.23	-	18,928,977.40	-112,032,686.83
其中: 1. 基金申购款	109,816,955.22	-	-13,669,840.12	96,147,115.10
2. 基金赎回款	-240,778,619.45	-	32,598,817.52	-208,179,801.93
(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)	770,390,644.65	-	-57,056,356.96	713,334,287.69

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：倡方方

## 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

#### 6.4.2.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%；经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自

2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

#### 6.4.2.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.2.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用

基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### 6.4.2.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.2.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 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	11,837,296.97
等于：本金	11,836,543.94
加：应计利息	753.03
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	11,837,296.97

#### 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	468,344,636.49	-	483,572,120.86	15,227,484.37
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	6.75	342,006.75	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	6.75	342,006.75	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	468,686,636.49	6.75	483,914,127.61	15,227,484.37

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-

权益衍生工具	15,519,300.00	-	-	-
---股指期货	15,519,300.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	15,519,300.00	-	-	-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 6.4.3.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2307	IM2307	3.00	3,944,880.00	115,180.00
IM2309	IM2309	9.00	11,765,520.00	75,920.00
合计	-	-	-	191,100.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	191,100.00
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 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	85.67
应付证券出借违约金	-



应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款	43,556.25
预提费用	149,260.15
合计	192,902.07

#### 6.4.3.8 实收基金

##### 博时专精特新主题混合 A

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	账面金额
上年度末	373,773,512.76	373,773,512.76
本期申购	34,182,923.18	34,182,923.18
本期赎回（以“-”号填列）	-47,833,556.95	-47,833,556.95
本期末	360,122,878.99	360,122,878.99

##### 博时专精特新主题混合 C

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	账面金额
上年度末	323,511,173.89	323,511,173.89
本期申购	19,256,053.64	19,256,053.64
本期赎回（以“-”号填列）	-47,372,661.91	-47,372,661.91
本期末	295,394,565.62	295,394,565.62

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

##### 博时专精特新主题混合 A

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	-60,368,666.35	-13,352,438.26	-73,721,104.61
本期利润	14,657,089.47	26,230,259.01	40,887,348.48
本期基金份额交易产生的变动数	1,937,578.66	-1,340,178.17	597,400.49
其中：基金申购款	-3,639,840.19	-1,647,222.44	-5,287,062.63
基金赎回款	5,577,418.85	307,044.27	5,884,463.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-43,773,998.22	11,537,642.58	-32,236,355.64

##### 博时专精特新主题混合 C

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	-53,647,617.72	-11,545,468.00	-65,193,085.72
本期利润	12,293,316.23	20,895,517.21	33,188,833.44
本期基金份额交易产生的变动数	3,472,919.74	-8,252.34	3,464,667.40
其中：基金申购款	-2,614,520.32	21,013.64	-2,593,506.68
基金赎回款	6,087,440.06	-29,265.98	6,058,174.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-37,881,381.75	9,341,796.87	-28,539,584.88

#### 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	14,594.40
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	845,649.47
其他	-
合计	860,243.87

#### 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	1,645,067,076.05
减：卖出股票成本总额	1,611,499,176.58
减：交易费用	3,504,641.62
买卖股票差价收入	30,063,257.85

#### 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	6.54
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	6.54
----	------

**6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

无发生额。

**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**

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-176,336.65

**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	2,054,215.46
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,054,215.46

**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	46,934,676.22
——股票投资	46,934,676.22
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	191,100.00
——权证投资	-
——股指期货	191,100.00

4. 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	47,125,776.22

#### 6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	28,953.22
基金转换费收入	2,563.75
合计	31,516.97

#### 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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,113.90
合计	91,374.05

#### 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、注册登记机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	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

无。

##### 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	4,389,697.12	5,744,395.61
其中：支付销售机构的客户维护费	1,864,109.33	2,384,254.38

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 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托管费	731,616.19	957,399.22

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。

###### 6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时专精特新主 题混合 A	博时专精特新主题混 合 C	合计
中信银行	-	120,922.99	120,922.99
博时基金	-	9,980.61	9,980.61
招商证券	-	1,510.16	1,510.16
合计	-	132,413.76	132,413.76
获得销售服务费的各 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		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时专精特新主题混合 A	博时专精特新主题混合 C	合计
中信银行	-	184,683.98	184,683.98
博时基金	-	11,391.94	11,391.94
招商证券	-	5,409.22	5,409.22
合计	-	201,485.14	201,485.14

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行-活期存款	11,837,296.97	14,594.40	8,308,292.41	55,326.06

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
招商证券股份有限公司	301428	世纪恒通	网下发行	2,289.00	60,315.15
招商证券股份有限公司	301305	朗坤环境	网下发行	7,523.00	189,955.75
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
688486	龙迅股份	2023-02-10	6 个月	首次公开发行限售	64.76	105.13	1,887.00	122,202.12	198,380.31	-
301486	致尚科技	2023-06-30	5 个交易日	新股未上市	57.66	57.66	3,155.00	181,917.30	181,917.30	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个交易日	新股未上市	26.68	26.68	4,676.00	124,755.68	124,755.68	-



30129 2	海科 新源	2023- 06-29	6 个交 易日	新股 未上 市	19.99	19.99	5,241 .00	104,7 67.59	104,7 67.59	-
30148 8	豪恩 汽电	2023- 06-26	6 个交 易日	新股 未上 市	39.78	39.78	2,356 .00	93,72 1.68	93,72 1.68	-
68830 7	中润 光学	2023- 02-08	6 个月	首次 公开 发行 限售	23.88	31.73	2,455 .00	58,62 5.40	77,89 7.15	-
30120 2	朗威 股份	2023- 06-28	5 个交 易日	新股 未上 市	25.82	25.82	2,754 .00	71,10 8.28	71,10 8.28	-
30126 1	恒工 精密	2023- 06-29	7 个交 易日	新股 未上 市	36.90	36.90	1,775 .00	65,49 7.50	65,49 7.50	-
68824 9	晶合 集成	2023- 04-24	6 个月	首次 公开 发行 限售	19.86	18.06	3,431 .00	68,13 9.66	61,96 3.86	-
68847 2	阿特 斯	2023- 06-02	6 个月	首次 公开 发行 限售	11.10	17.04	2,296 .00	25,48 5.60	39,12 3.84	-
30132 5	曼恩 斯特	2023- 05-04	6 个月	首次 公开 发行 限售	76.80	107.9 5	305.0 0	23,42 4.00	32,92 4.75	-
68836 1	中科 飞测	2023- 05-12	6 个月	首次 公开 发行 限售	23.60	64.67	509.0 0	12,01 2.40	32,91 7.03	-
68846 9	中芯 集成	2023- 04-28	6 个月	首次 公开 发行 限售	5.69	5.41	6,045 .00	34,39 6.05	32,70 3.45	-
30130 1	川宁 生物	2022- 12-20	6 个月	首次 公开 发行 限售	5.00	8.96	3,574 .00	17,87 0.00	32,02 3.04	-
30135 8	湖南 裕能	2023- 02-01	6 个月	首次 公开 发行 限售	23.77	42.89	657.0 0	15,61 6.89	28,17 8.73	-

688576	西山科技	2023-05-30	6 个月	首次公开发行限售	135.80	120.41	217.00	29,468.60	26,128.97	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	首次公开发行限售	37.88	29.49	867.00	32,841.96	25,567.83	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	首次公开发行限售	38.13	31.03	791.00	30,160.83	24,544.73	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	首次公开发行限售	29.60	71.42	333.00	9,856.80	23,782.86	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	首次公开发行限售	26.74	40.68	573.00	15,322.02	23,309.64	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	首次公开发行限售	39.99	36.71	628.00	25,113.72	23,053.88	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	首次公开发行限售	36.15	38.13	581.00	21,003.15	22,153.53	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	首次公开发行限售	152.38	135.97	162.00	24,685.56	22,027.14	-
301307	美利信	2023-04-14	6 个月	首次公开发行限售	32.34	31.86	687.00	22,217.58	21,887.82	-
688543	国科军工	2023-06-14	6 个月	首次公开发行限售	43.67	53.05	410.00	17,904.70	21,750.50	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6 个月	首次公开发行限售	26.80	22.32	931.00	24,950.80	20,779.92	-

301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	首次公开发行限售	57.66	57.66	351.00	20,238.66	20,238.66	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6 个月	首次公开发行限售	50.00	30.71	621.00	31,050.00	19,070.91	-
688352	顾中科技	2023-04-11	6 个月	首次公开发行限售	12.10	12.07	1,543.00	18,670.30	18,624.01	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月	首次公开发行限售	75.00	90.76	204.00	15,300.00	18,515.04	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	首次公开发行限售	11.88	21.02	860.00	10,216.80	18,077.20	-
301383	天键股份	2023-05-31	6 个月	首次公开发行限售	46.16	35.72	493.00	22,756.88	17,609.96	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月	首次公开发行限售	32.52	42.37	402.00	13,073.04	17,032.74	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	首次公开发行限售	21.17	23.50	724.00	15,327.08	17,014.00	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	首次公开发行限售	125.80	118.03	142.00	17,863.60	16,760.26	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	首次公开发行限售	12.68	22.31	726.00	9,205.68	16,197.06	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	首次公开发行限售	14.81	13.73	1,122.00	16,616.82	15,405.06	-

301408	华人健康	2023-02-22	6 个月	首次公开发行限售	16.24	16.95	879.00	14,274.96	14,899.05	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	首次公开发行限售	25.25	19.69	753.00	19,013.25	14,826.57	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6 个月	首次公开发行限售	87.41	53.24	276.00	24,124.24	14,694.24	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6 个月	首次公开发行限售	24.80	43.85	330.00	8,184.00	14,470.50	-
688334	西高院	2023-06-09	6 个月	首次公开发行限售	14.16	16.21	888.00	12,574.08	14,394.48	-
688593	新相微	2023-05-25	6 个月	首次公开发行限售	11.18	14.59	959.00	10,721.62	13,991.81	-
301387	光大同创	2023-04-10	6 个月	首次公开发行限售	58.32	45.36	307.00	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个月	首次公开发行限售	26.68	26.68	520.00	13,873.60	13,873.60	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6 个月	首次公开发行限售	57.88	49.17	281.00	16,264.28	13,816.77	-
688512	慧智微	2023-05-08	6 个月	首次公开发行限售	20.92	19.16	721.00	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	首次公开发行限售	23.80	32.84	408.00	9,710.40	13,398.72	-

301320	豪江智能	2023-06-01	6 个月	首次公开发行限售	13.06	20.62	642.00	8,384.52	13,238.04	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	首次公开发行限售	26.66	31.50	418.00	11,143.88	13,167.00	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月	首次公开发行限售	9.26	18.59	708.00	6,556.08	13,161.72	-
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月	首次公开发行限售	10.68	12.34	1,016.00	10,850.88	12,537.44	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	首次公开发行限售	71.88	92.60	134.00	9,631.92	12,408.40	-
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月	首次公开发行限售	6.58	7.58	1,632.00	10,738.56	12,370.56	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	首次公开发行限售	19.99	16.90	702.00	14,032.98	11,863.80	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个月	首次公开发行限售	19.99	19.99	583.00	11,654.17	11,654.17	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	首次公开发行限售	21.86	23.85	472.00	10,317.92	11,257.20	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6 个月	首次公开发行限售	41.20	42.69	262.00	10,794.40	11,184.78	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	首次公开发行限售	39.78	39.78	262.00	10,422.36	10,422.36	-

603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	首次公开发行限售	17.80	17.89	580.00	10,324.00	10,376.20	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	首次公开发行限售	25.28	29.87	336.00	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	首次公开发行限售	33.99	29.49	332.00	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	首次公开发行限售	72.50	58.42	165.00	11,962.50	9,639.30	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	首次公开发行限售	73.45	46.64	206.00	15,130.70	9,607.84	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	首次公开发行限售	17.55	16.75	563.00	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6 个月	首次公开发行限售	50.00	48.39	190.00	9,500.00	9,194.10	-
301386	未来电器	2023-03-21	6 个月	首次公开发行限售	29.99	23.79	378.00	11,336.22	8,992.62	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	首次公开发行限售	39.06	39.36	228.00	8,905.68	8,974.08	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6 个月	首次公开发行限售	33.73	31.85	277.00	9,343.21	8,822.45	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	首次公开发行限售	34.00	34.93	250.00	8,500.00	8,732.50	-

688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	首次公开发售	35.00	51.23	161.00	5,635.00	8,248.03	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	首次公开发售	25.82	25.82	306.00	7,900.92	7,900.92	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6 个月	首次公开发售	37.40	36.07	215.00	8,041.00	7,755.05	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6 个月	首次公开发售	46.13	34.40	225.00	10,379.25	7,740.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月	首次公开发售	36.90	36.90	198.00	7,306.20	7,306.20	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	首次公开发售	11.66	12.26	574.00	6,692.84	7,037.24	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	首次公开发售	26.35	30.60	229.00	6,034.15	7,007.40	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	首次公开发售	10.36	11.84	559.00	5,791.24	6,618.56	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6 个月	首次公开发售	28.84	30.78	170.00	4,902.80	5,232.60	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	首次公开发售	25.98	24.53	160.00	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	首次公开发售	20.68	25.49	145.00	2,998.60	3,696.05	-



001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	首次公开发行限售	27.93	33.03	105.00	2,932.65	3,468.15	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	首次公开发行限售	15.38	14.87	177.00	2,722.26	2,631.99	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月	首次公开发行限售	15.90	17.09	139.00	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月	首次公开发行限售	18.88	19.60	114.00	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	首次公开发行限售	44.48	39.48	55.00	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	首次公开发行限售	14.58	16.13	122.00	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
118036	力合转债	2023-06-28	16 个交易日	新债未上市	100.00	100.00	3,420.00	342,000.00	342,006.75	-

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。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主要投资于专精特新主题的上市公司股票。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。

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均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	342,006.75	-
未评级	-	-
合计	342,006.75	-

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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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
<b>资产</b>					
银行存款	11,837,296.97	-	-	-	11,837,296.97
结算备付金	98,973,000.35	-	-	-	98,973,000.35
存出保证金	-	-	-	1,885,248.00	1,885,248.00
交易性金融资产	-	-	342,006.75	483,572,120.86	483,914,127.61
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	96,893.92	96,893.92
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>110,810,297.32</b>	<b>-</b>	<b>342,006.75</b>	<b>485,554,262.78</b>	<b>596,706,566.85</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	829,044.47	829,044.47
应付清算款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	716,707.44	716,707.44
应付托管费	-	-	-	119,451.26	119,451.26
应付销售服务费	-	-	-	106,957.29	106,957.29
应交税费	-	-	-	0.23	0.23
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	192,902.07	192,902.07
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>1,965,062.76</b>	<b>1,965,062.76</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>110,810,297.32</b>	-	<b>342,006.75</b>	<b>483,589,200.02</b>	<b>594,741,504.09</b>
<b>上年度末 2022年12月31日</b>	<b>1年以内</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	9,432,589.03	-	-	-	9,432,589.03
结算备付金	98,336,371.14	-	-	-	98,336,371.14
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	451,658,268.14	451,658,268.14
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	697,372.00	697,372.00
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>107,768,960.17</b>	-	-	<b>452,355,640.14</b>	<b>560,124,600.31</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	605,009.39	605,009.39
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	733,617.66	733,617.66
应付托管费	-	-	-	122,269.61	122,269.61
应付销售服务费	-	-	-	113,194.80	113,194.80
应交税费	-	-	-	0.65	0.65
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	180,011.88	180,011.88
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>1,754,103.99</b>	<b>1,754,103.99</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>107,768,960.17</b>	<b>0.00</b>	-	<b>450,601,536.15</b>	<b>558,370,496.32</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规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	483,572,120.86	81.31	451,658,268.14	80.89
交易性金融资产—债券投资	342,006.75	0.06	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>483,914,127.61</b>	<b>81.37</b>	<b>451,658,268.14</b>	<b>80.89</b>

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日



	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,793	增加约 2,041
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,793	减少约 2,041

#### 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	481,464,425.36
第二层次	1,055,170.69
第三层次	1,394,531.56
合计	483,914,127.61

###### 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	483,572,120.86	81.04
	其中：股票	483,572,120.86	81.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	342,006.75	0.06
	其中：债券	342,006.75	0.06
	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	110,810,297.32	18.57
8	其他各项资产	1,982,141.92	0.33
9	合计	596,706,566.85	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	971,776.00	0.16
B	采矿业	464,940.00	0.08
C	制造业	427,669,685.67	71.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,379,434.75	0.74
F	批发和零售业	3,743,941.81	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	1,864,112.00	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,739,138.08	4.16
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	915,995.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	931,584.48	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	17,867,730.21	3.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	483,572,120.86	81.31

### 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	001223	欧克科技	232,100	21,118,779.00	3.55
2	601702	华峰铝业	761,100	10,411,848.00	1.75
3	688332	中科蓝讯	81,511	6,820,840.48	1.15
4	688281	华秦科技	27,873	5,644,282.50	0.95
5	688667	菱电电控	74,375	5,550,606.25	0.93
6	688186	广大特材	155,393	5,054,934.29	0.85
7	603330	天洋新材	424,680	4,718,194.80	0.79
8	002890	弘宇股份	318,880	4,709,857.60	0.79
9	688257	新锐股份	175,270	4,646,407.70	0.78
10	603949	雪龙集团	292,100	4,609,338.00	0.78
11	301100	风光股份	221,600	4,578,256.00	0.77
12	300412	迦南科技	766,900	4,547,717.00	0.76
13	301009	可靠股份	390,900	4,546,167.00	0.76
14	603041	美思德	372,600	4,478,652.00	0.75
15	300440	运达科技	624,000	4,411,680.00	0.74
16	300535	达威股份	300,000	4,368,000.00	0.73
17	300990	同飞股份	86,460	4,348,938.00	0.73
18	002560	通达股份	456,607	4,346,898.64	0.73
19	002337	赛象科技	649,300	4,337,324.00	0.73
20	300405	科隆股份	783,400	4,285,198.00	0.72
21	688072	拓荆科技	9,829	4,186,859.13	0.70
22	300838	浙江力诺	225,400	4,118,058.00	0.69
23	300417	南华仪器	382,600	4,109,124.00	0.69
24	300611	美力科技	424,700	4,094,108.00	0.69
25	300539	横河精密	274,700	4,068,307.00	0.68
26	300717	华信新材	237,300	4,045,965.00	0.68
27	603956	威派格	505,200	4,036,548.00	0.68
28	688218	江苏北人	181,516	3,995,167.16	0.67
29	301040	中环海陆	193,700	3,980,535.00	0.67
30	300929	华骐环保	349,800	3,963,234.00	0.67
31	300407	凯发电气	429,800	3,924,074.00	0.66
32	301148	嘉戎技术	182,900	3,910,402.00	0.66
33	002231	奥维通信	559,100	3,908,109.00	0.66

34	688011	新光光电	151,259	3,905,507.38	0.66
35	300876	蒙泰高新	149,900	3,904,895.00	0.66
36	002296	辉煌科技	453,700	3,901,820.00	0.66
37	688722	同益中	209,438	3,882,980.52	0.65
38	002686	亿利达	549,000	3,870,450.00	0.65
39	300283	温州宏丰	655,800	3,869,220.00	0.65
40	300076	GQY 视讯	753,600	3,843,360.00	0.65
41	603088	宁波精达	458,300	3,840,554.00	0.65
42	603158	腾龙股份	501,000	3,837,660.00	0.65
43	600288	大恒科技	312,200	3,768,254.00	0.63
44	601908	京运通	619,600	3,748,580.00	0.63
45	603191	望变电气	191,000	3,714,950.00	0.62
46	688589	力合微	90,435	3,684,321.90	0.62
47	688711	宏微科技	63,030	3,677,170.20	0.62
48	603166	福达股份	543,600	3,663,864.00	0.62
49	688208	道通科技	119,600	3,625,076.00	0.61
50	300920	润阳科技	210,000	3,614,100.00	0.61
51	003017	大洋生物	107,400	3,614,010.00	0.61
52	300971	博亚精工	135,200	3,549,000.00	0.60
53	603321	梅轮电梯	448,700	3,495,373.00	0.59
54	688178	万德斯	178,196	3,455,220.44	0.58
55	688622	禾信仪器	95,854	3,402,817.00	0.57
56	301268	铭利达	80,600	3,374,722.00	0.57
57	688020	方邦股份	67,100	3,352,987.00	0.56
58	300479	神思电子	163,300	3,301,926.00	0.56
59	300385	雪浪环境	539,400	3,301,128.00	0.56
60	300930	屹通新材	130,500	3,255,975.00	0.55
61	603078	江化微	192,829	3,199,033.11	0.54
62	300588	熙菱信息	270,800	3,130,448.00	0.53
63	688132	邦彦技术	114,298	3,106,619.64	0.52
64	688106	金宏气体	112,417	3,057,742.40	0.51
65	300195	长荣股份	478,400	3,004,352.00	0.51
66	002931	锋龙股份	229,900	3,000,195.00	0.50
67	300234	开尔新材	541,500	2,902,440.00	0.49
68	603678	火炬电子	80,600	2,777,476.00	0.47
69	301288	清研环境	159,000	2,744,340.00	0.46
70	603786	科博达	40,400	2,654,280.00	0.45
71	001336	楚环科技	94,300	2,638,514.00	0.44
72	836077	吉林碳谷	128,723	2,629,810.89	0.44
73	300162	雷曼光电	368,300	2,585,466.00	0.43
74	601798	蓝科高新	335,900	2,549,481.00	0.43
75	300817	双飞股份	168,400	2,517,580.00	0.42
76	688021	奥福环保	93,600	2,426,112.00	0.41

77	603192	汇得科技	120,000	2,290,800.00	0.39
78	001269	欧晶科技	30,726	2,259,282.78	0.38
79	300827	上能电气	59,994	2,162,783.70	0.36
80	300885	海昌新材	202,300	2,105,943.00	0.35
81	300800	力合科技	151,300	2,089,453.00	0.35
82	002324	普利特	145,800	2,080,566.00	0.35
83	002809	红墙股份	188,700	2,037,960.00	0.34
84	002817	黄山胶囊	233,500	2,026,780.00	0.34
85	603290	斯达半导	9,200	1,979,840.00	0.33
86	688190	云路股份	26,933	1,966,109.00	0.33
87	688510	航亚科技	98,386	1,956,897.54	0.33
88	300200	高盟新材	229,000	1,948,790.00	0.33
89	300488	恒锋工具	75,900	1,933,932.00	0.33
90	002877	智能自控	189,300	1,919,502.00	0.32
91	002997	瑞鹄模具	64,400	1,914,612.00	0.32
92	300337	银邦股份	286,100	1,908,287.00	0.32
93	688676	金盘科技	62,905	1,905,392.45	0.32
94	688063	派能科技	9,600	1,903,200.00	0.32
95	002522	浙江众成	371,600	1,902,592.00	0.32
96	688199	久日新材	63,243	1,885,906.26	0.32
97	001256	炜冈科技	102,100	1,878,640.00	0.32
98	603131	上海沪工	149,100	1,865,241.00	0.31
99	300239	东宝生物	301,700	1,858,472.00	0.31
100	603396	金辰股份	28,300	1,856,480.00	0.31
101	002970	锐明技术	58,400	1,839,016.00	0.31
102	301218	华是科技	77,900	1,822,081.00	0.31
103	301089	拓新药业	29,300	1,814,842.00	0.31
104	301283	聚胶股份	51,000	1,809,480.00	0.30
105	300213	佳讯飞鸿	271,000	1,807,570.00	0.30
106	300853	申昊科技	50,100	1,758,510.00	0.30
107	300190	维尔利	433,600	1,730,064.00	0.29
108	002698	博实股份	98,700	1,726,263.00	0.29
109	300816	艾可蓝	58,300	1,721,599.00	0.29
110	002214	大立科技	125,300	1,710,345.00	0.29
111	688026	洁特生物	93,000	1,699,110.00	0.29
112	301019	宁波色母	81,000	1,671,840.00	0.28
113	603895	天永智能	62,600	1,598,178.00	0.27
114	300177	中海达	222,300	1,504,971.00	0.25
115	688070	纵横股份	31,000	1,422,900.00	0.24
116	000977	浪潮信息	25,700	1,246,450.00	0.21
117	688041	海光信息	17,400	1,187,898.00	0.20
118	688211	中科微至	24,800	1,120,216.00	0.19
119	301081	严牌股份	112,140	1,115,793.00	0.19

120	688560	明冠新材	40,000	1,111,600.00	0.19
121	301388	欣灵电气	40,500	1,087,425.00	0.18
122	002381	双箭股份	138,700	1,070,764.00	0.18
123	688057	金达莱	75,200	1,070,096.00	0.18
124	688768	容知日新	13,079	1,044,619.73	0.18
125	688448	磁谷科技	30,329	1,038,161.67	0.17
126	002731	萃华珠宝	69,900	997,473.00	0.17
127	603822	嘉澳环保	30,400	989,520.00	0.17
128	300970	华绿生物	41,600	971,776.00	0.16
129	002972	科安达	76,600	968,990.00	0.16
130	002981	朝阳科技	40,200	968,820.00	0.16
131	603655	朗博科技	38,500	964,810.00	0.16
132	300889	爱克股份	64,200	961,074.00	0.16
133	002952	亚世光电	54,000	957,420.00	0.16
134	688255	凯尔达	28,243	956,307.98	0.16
135	002811	郑中设计	119,500	947,635.00	0.16
136	603535	嘉诚国际	58,100	943,544.00	0.16
137	605566	福莱茵特	41,000	943,000.00	0.16
138	300577	开润股份	57,800	941,562.00	0.16
139	605189	富春染织	57,300	940,293.00	0.16
140	600602	云赛智联	62,400	939,744.00	0.16
141	301003	江苏博云	40,600	938,266.00	0.16
142	301092	争光股份	35,800	937,244.00	0.16
143	603810	丰山集团	68,000	936,360.00	0.16
143	002631	德尔未来	173,400	936,360.00	0.16
144	600778	友好集团	137,400	934,320.00	0.16
145	300621	维业股份	93,200	932,932.00	0.16
146	300530	领湃科技	41,100	930,504.00	0.16
147	300176	派生科技	151,000	930,160.00	0.16
148	300658	延江股份	141,900	929,445.00	0.16
149	301063	海锅股份	33,300	927,738.00	0.16
150	002963	豪尔赛	63,700	926,835.00	0.16
151	301259	艾布鲁	68,700	924,015.00	0.16
152	600051	宁波联合	126,900	923,832.00	0.16
153	300411	金盾股份	141,000	923,550.00	0.16
154	300932	三友联众	59,740	922,385.60	0.16
155	000619	海螺新材	151,000	921,100.00	0.15
156	603214	爱婴室	56,600	920,882.00	0.15
157	000548	湖南投资	190,200	920,568.00	0.15
158	600865	百大集团	107,300	919,561.00	0.15
159	002949	华阳国际	64,500	917,190.00	0.15
160	300805	电声股份	109,700	915,995.00	0.15
161	605287	德才股份	38,600	914,820.00	0.15

162	603331	百达精工	61,800	913,404.00	0.15
163	003030	祖名股份	37,800	912,492.00	0.15
164	300004	南风股份	168,200	908,280.00	0.15
165	002779	中坚科技	34,500	907,695.00	0.15
166	603903	中持股份	101,500	907,410.00	0.15
167	003038	鑫铂股份	18,800	779,448.00	0.13
168	002281	光迅科技	21,000	778,890.00	0.13
169	605389	长龄液压	25,400	733,298.00	0.12
170	003025	思进智能	43,415	701,152.25	0.12
171	603489	八方股份	9,880	692,785.60	0.12
172	603590	康辰药业	20,800	690,560.00	0.12
173	603089	正裕工业	77,500	688,975.00	0.12
174	603579	荣泰健康	32,600	681,992.00	0.11
175	301160	翔楼新材	19,400	681,910.00	0.11
176	688059	华锐精密	8,100	678,375.00	0.11
177	300610	晨化股份	58,400	678,024.00	0.11
178	300305	裕兴股份	62,700	677,160.00	0.11
179	603203	快克智能	21,800	671,004.00	0.11
180	603095	越剑智能	43,400	670,530.00	0.11
181	603272	联翔股份	39,500	669,920.00	0.11
182	603725	天安新材	82,000	666,660.00	0.11
183	688071	华依科技	10,900	666,535.00	0.11
184	603607	京华激光	46,200	666,204.00	0.11
185	300758	七彩化学	67,000	665,310.00	0.11
186	688618	三旺通信	9,781	662,369.32	0.11
187	002996	顺博合金	54,700	661,870.00	0.11
188	605305	中际联合	18,900	658,854.00	0.11
189	603098	森特股份	31,600	647,800.00	0.11
190	605399	晨光新材	36,300	646,140.00	0.11
191	001266	宏英智能	22,200	644,910.00	0.11
192	603360	百傲化学	63,400	642,876.00	0.11
193	603201	常润股份	27,760	636,536.80	0.11
194	603681	永冠新材	44,200	631,176.00	0.11
195	688267	中触媒	29,600	623,672.00	0.10
196	688168	安博通	16,900	601,640.00	0.10
197	300648	星云股份	18,500	595,330.00	0.10
198	603115	海星股份	37,600	577,912.00	0.10
199	300474	景嘉微	6,300	566,937.00	0.10
200	688236	春立医疗	23,100	565,950.00	0.10
201	688184	帕瓦股份	18,000	562,680.00	0.09
202	603657	春光科技	31,800	558,090.00	0.09
203	688625	呈和科技	13,700	536,903.00	0.09
204	003033	征和工业	15,200	533,520.00	0.09



205	301008	宏昌科技	18,200	511,966.00	0.09
206	301309	万得凯	18,568	511,362.72	0.09
207	301300	远翔新材	16,100	508,760.00	0.09
208	300701	森霸传感	45,300	495,129.00	0.08
209	300308	中际旭创	3,200	471,840.00	0.08
210	300394	天孚通信	4,400	470,052.00	0.08
211	603132	金徽股份	41,000	464,940.00	0.08
212	601138	工业富联	18,400	463,680.00	0.08
213	600845	宝信软件	9,000	457,290.00	0.08
214	300502	新易盛	6,600	448,602.00	0.08
215	301182	凯旺科技	19,300	443,321.00	0.07
216	300980	祥源新材	22,000	442,420.00	0.07
217	002261	拓维信息	21,200	409,372.00	0.07
218	300153	科泰电源	48,200	403,916.00	0.07
219	300044	赛为智能	80,000	393,600.00	0.07
220	002757	南兴股份	24,400	393,572.00	0.07
221	000066	中国长城	27,800	384,474.00	0.06
222	000158	常山北明	47,400	383,466.00	0.06
223	300183	东软载波	23,200	383,032.00	0.06
224	300053	航宇微	28,000	381,080.00	0.06
225	688155	先惠技术	7,000	379,820.00	0.06
226	300047	天源迪科	46,600	379,324.00	0.06
227	002837	英维克	12,600	377,244.00	0.06
228	603019	中科曙光	7,400	376,660.00	0.06
229	300339	润和软件	15,600	373,776.00	0.06
230	300052	中青宝	18,400	372,048.00	0.06
231	600797	浙大网新	51,600	368,424.00	0.06
232	300603	立昂技术	30,000	368,400.00	0.06
233	300738	奥飞数据	36,000	367,200.00	0.06
234	300515	三德科技	22,700	365,924.00	0.06
235	002197	证通电子	34,600	364,684.00	0.06
236	300249	依米康	37,400	363,528.00	0.06
237	300613	富瀚微	6,400	363,136.00	0.06
238	300442	润泽科技	11,800	362,968.00	0.06
239	600100	同方股份	44,400	360,528.00	0.06
240	300383	光环新网	32,800	352,600.00	0.06
241	603881	数据港	15,600	352,404.00	0.06
242	300465	高伟达	35,200	349,536.00	0.06
243	300166	东方国信	30,600	343,944.00	0.06
244	603912	佳力图	33,700	343,740.00	0.06
245	001339	智微智能	11,400	338,238.00	0.06
246	002156	通富微电	14,800	334,480.00	0.06
247	688158	优刻得	17,400	328,512.00	0.06

248	300245	天玑科技	32,100	306,555.00	0.05
249	688162	巨一科技	7,335	304,255.80	0.05
250	688316	青云科技	5,800	287,970.00	0.05
251	688228	开普云	5,600	287,616.00	0.05
252	688582	芯动联科	5,726	264,727.69	0.04
253	301291	明阳电气	7,907	256,526.33	0.04
254	301486	致尚科技	3,506	202,155.96	0.03
255	688486	龙迅股份	1,887	198,380.31	0.03
256	688193	仁度生物	4,361	187,871.88	0.03
257	688069	德林海	7,680	163,123.20	0.03
258	002942	新农股份	8,500	154,275.00	0.03
259	688256	寒武纪	800	150,400.00	0.03
260	300895	铜牛信息	4,400	146,960.00	0.02
261	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.02
262	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.02
263	688093	世华科技	6,130	122,967.80	0.02
264	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
265	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
266	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
267	688307	中润光学	2,455	77,897.15	0.01
268	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
269	688249	晶合集成	3,431	61,963.86	0.01
270	688472	阿特斯	2,296	39,123.84	0.01
271	301325	曼恩斯特	305	32,924.75	0.01
272	688361	中科飞测	509	32,917.03	0.01
273	688469	中芯集成	6,045	32,703.45	0.01
274	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
275	301358	湖南裕能	657	28,178.73	0.00
276	688576	西山科技	217	26,128.97	0.00
277	688443	智翔金泰	867	25,567.83	0.00
278	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
279	688484	南芯科技	628	23,053.88	0.00
280	688146	中船特气	581	22,153.53	0.00
281	688531	日联科技	162	22,027.14	0.00
282	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
283	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
284	301303	真兰仪表	931	20,779.92	0.00
285	301246	宏源药业	621	19,070.91	0.00
286	688352	硕中科技	1,543	18,624.01	0.00
287	688458	美芯晟	204	18,515.04	0.00
288	001287	中电港	860	18,077.20	0.00
289	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
290	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00

291	688552	航天南湖	724	17,014.00	0.00
292	688581	安杰思	142	16,760.26	0.00
293	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
294	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
295	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
296	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
297	301322	绿通科技	276	14,694.24	0.00
298	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
299	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
300	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
301	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
302	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
303	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
304	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
305	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
306	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
307	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
308	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
309	601061	中信金属	1,632	12,370.56	0.00
310	301439	泓淋电力	702	11,863.80	0.00
311	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
312	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
313	603135	中重科技	580	10,376.20	0.00
314	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
315	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
316	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
317	301345	涛涛车业	206	9,607.84	0.00
318	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
319	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
320	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
321	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
322	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
323	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
324	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
325	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
326	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
327	601133	柏诚股份	574	7,037.24	0.00
328	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
329	601065	江盐集团	559	6,618.56	0.00
330	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
331	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
332	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
333	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00

334	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
335	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
336	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
337	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
338	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	001223	欧克科技	16,207,689.00	2.90
2	688722	同益中	11,048,541.59	1.98
3	601186	中国铁建	10,992,821.00	1.97
4	002337	赛象科技	10,398,732.00	1.86
5	301028	东亚机械	9,705,318.59	1.74
6	300007	汉威科技	9,211,621.00	1.65
7	600288	大恒科技	8,899,539.00	1.59
8	300839	博汇股份	8,594,605.20	1.54
9	300611	美力科技	8,537,417.98	1.53
10	300407	凯发电气	8,357,261.00	1.50
11	603041	美思德	8,141,885.00	1.46
12	688630	芯碁微装	8,027,034.60	1.44
13	603158	腾龙股份	7,913,510.00	1.42
14	300200	高盟新材	7,844,404.13	1.40
15	688676	金盘科技	7,487,699.53	1.34
16	688218	江苏北人	7,462,433.04	1.34
17	300234	开尔新材	7,438,646.00	1.33
18	003017	大洋生物	7,380,619.00	1.32
19	603333	尚纬股份	7,143,972.00	1.28
20	688165	埃夫特	7,119,861.18	1.28

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	688037	芯源微	12,912,561.46	2.31
2	300306	远方信息	12,624,768.00	2.26
3	301086	鸿富瀚	12,567,406.00	2.25

4	002587	奥拓电子	11,344,805.00	2.03
5	601186	中国铁建	11,101,130.00	1.99
6	300007	汉威科技	10,915,415.00	1.95
7	688195	腾景科技	10,713,407.03	1.92
8	002962	五方光电	10,322,620.72	1.85
9	688165	埃夫特	10,171,506.47	1.82
10	301028	东亚机械	10,050,520.32	1.80
11	002392	北京利尔	9,890,887.00	1.77
12	688063	派能科技	9,447,069.32	1.69
13	688287	观典防务	9,434,232.11	1.69
14	300820	英杰电气	9,400,665.00	1.68
15	002869	金溢科技	9,370,130.91	1.68
16	300701	森霸传感	9,352,384.75	1.67
17	688510	航亚科技	8,958,603.23	1.60
18	301007	德迈仕	8,931,043.00	1.60
19	688589	力合微	8,843,658.50	1.58
20	300234	开尔新材	8,791,523.98	1.57

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,596,478,353.08
卖出股票的收入（成交）总额	1,645,067,076.05

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）	342,006.75	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	342,006.75	0.06

## 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	118036	力合转债	3,420	342,006.75	0.06

## 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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

## 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	1,885,248.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	96,893.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,982,141.92

#### 7.12.4 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。

#### 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

份额级别	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
博时专精特新主题混合 A	17,607	20,453.39	24,076,717.28	6.69%	336,046,161.71	93.31%
博时专精特新主题混合 C	14,588	20,249.15	841,807.83	0.28%	294,552,757.79	99.72%
合计	31,485	20,819.99	24,918,525.11	3.80%	630,598,919.50	96.20%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	博时专精特新主题混合 A	169,714.93	0.05%
	博时专精特新主题混合	2,573.72	0.00%

	C		
	合计	172,288.65	0.03%

### 8.3 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时专精特新主题混合 A	-
	博时专精特新主题混合 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时专精特新主题混合 A	10~50
	博时专精特新主题混合 C	0~10
	合计	10~50

注：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。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时专精特新主题混合 A	博时专精特新主题混合 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 6 日）基金份额总额	460,652,880.83	440,699,428.05
本报告期期初基金份额总额	373,773,512.76	323,511,173.89
本报告期基金总申购份额	34,182,923.18	19,256,053.64
减：本报告期基金总赎回份额	47,833,556.95	47,372,661.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	360,122,878.99	295,394,565.62

## § 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，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到董事长、非执行董事朱鹤新先生的辞呈。董事会选举本行党委书记、副董事长、董事方合英先生为本行董事长，将自中国银行业监管机构核准其董事长任职资格之日起正式就任。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到本行行长方合英先生的辞呈。董事会聘任本行党委副书记、董事、常务副行长刘成先生为本行行长，将自中国银行业监管机构核准其行长任职资格之日起正式就任。

### 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，聘请安永华明会计师事务所（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	
东方财富证券	3	3,229,726,526.85	100.00%	1,601,010.08	100.00%	-

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

- 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，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用证券公司交易结算模式进行证券交易和结算的需要；
- 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服务；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；
- 4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足证券公司交易结算模式下估值的时效性要求。

### 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
东方财富证券	-	-	-	-	-	-

### 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	中国证券报、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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-27
3	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-17
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-12
5	博时专精特新主题混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-22
6	博时专精特新主题混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-30

		露网站	
7	博时专精特新主题混合型证券投资基金(博时专精特新主题混合 A) 基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-09
8	博时专精特新主题混合型证券投资基金(博时专精特新主题混合 C) 基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-09
9	博时专精特新主题混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-08
10	博时基金管理有限公司关于博时专精特新主题混合型证券投资基金的基金经理变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-08
11	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-18
12	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-13
13	博时专精特新主题混合型证券投资基金(博时专精特新主题混合 A) 基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-03
14	博时专精特新主题混合型证券投资基金(博时专精特新主题混合 C) 基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-03
15	博时专精特新主题混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-01
16	博时基金管理有限公司关于博时专精特新主题混合型证券投资基金的基金经理变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-01
17	博时专精特新主题混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-20
18	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	中国证券报、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专精特新主题混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时专精特新主题混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时专精特新主题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、博时专精特新主题混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时专精特新主题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