博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 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 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时中证 1000 增强 ETF
场内简称	1000 增强 ETF 博时
基金主代码	561780
交易代码	561780
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 11 月 2 日
报告期末基金份额总额	19,355,790.00 份
投资目标	本基金通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，在对标的指数有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上，通过量化增强等增强策略进行组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。本基金将以博时数量化模型对股票的回报预测为基础，综合考虑组合与业绩比较基准的跟踪误差、行业偏离、交易成本等，进行投资组合构建和优化。

	投资组合的股票选择将以指数成份股及备选成份股为主，并根据博时数量化模型对股票的回报预测，优先选择成份股和非成份股中综合评估较高的股票，对指数中的股票权重进行调整，以达到指数增强的目的。本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，预期年化跟踪误差不超过 6.5%。本基金的投资策略还包括债券（除可转换债券、可交换债券外）投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、衍生品投资策略、融资和转融通证券出借的投资策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪中证 1000 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司

§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 (2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	-1,591,844.13
2.本期利润	-3,575,998.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1874
4.期末基金资产净值	29,176,955.60
5.期末基金份额净值	1.5074

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

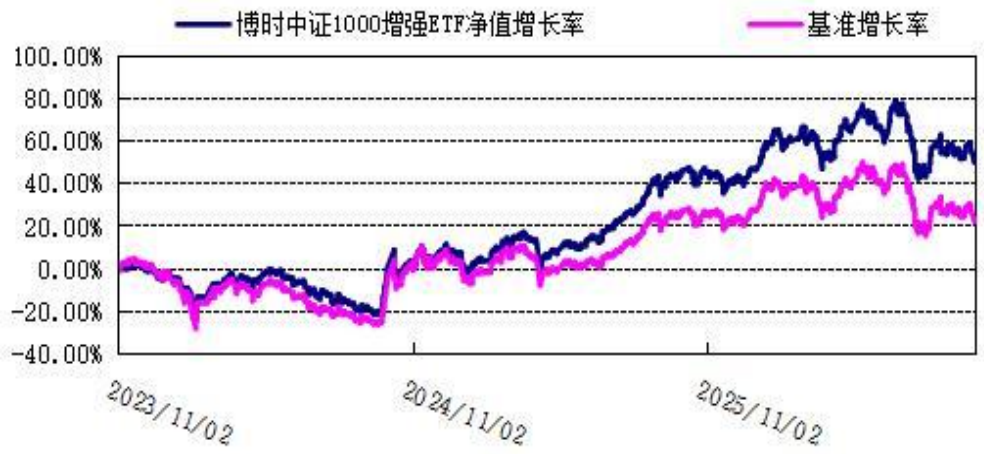
字。

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	-14.72%	1.98%	-17.15%	2.08%	2.43%	-0.10%
过去六个月	-0.83%	1.81%	-4.21%	1.88%	3.38%	-0.07%
过去一年	3.26%	1.60%	-3.65%	1.66%	6.91%	-0.06%
自基金合同生效起至今	50.74%	1.69%	22.50%	1.75%	28.24%	-0.06%

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		
杨振建	基金经理	2023-11-02	-	13.0	杨振建先生，博士。2013 年至 2015 年在中证指数有限公司工作（期间借调中国证

					监会任产品审核员）。2015 年加入博时基金管理有限公司。历任研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理助理、博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日-2021 年 7 月 16 日)、博时中证 A500 指数型证券投资基金(2024 年 10 月 30 日-2024 年 11 月 28 日)、博时中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 5 月 14 日-2026 年 5 月 21 日)的基金经理。现任博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 9 月 20 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019 年 11 月 13 日—至今)、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2020 年 12 月 23 日—至今)、博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 3 月 3 日—至今)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 7 月 27 日—至今)、博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 11 月 2 日—至今)、博时中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 4 月 16 日—至今)、博时中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 7 月 19 日—至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 11

					月 21 日—至今)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2024 年 11 月 27 日—至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 11 月 29 日—至今)、博时中证 800 指数增强型证券投资基金(2025 年 9 月 2 日—至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2025 年 11 月 3 日—至今)的基金经理。

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 11 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

宏观层面，经济运行总体平稳，出口链条延续较强韧性，新业态、新动能加快培育壮大；政策上延续"

更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策"基调，逆周期和跨周期调节力度持续加大，流动性保持合理充裕。2026 年三季度，海外科技股调整与地缘扰动增多，市场风险偏好阶段性波动；A 股震荡调整、风格再平衡，科技成长回调，资源红利与低估值蓝筹相对占优。经过结构性调整，市场估值分化有所收敛，部分高景气赛道估值仍处历史较高分位、需关注短期波动风险，而低估值蓝筹及红利资产仍具备较好的安全边际与配置性价比。从盈利预期看，PPI 延续回升，制造业 PMI 重回景气扩张区间，宏观基本面有望稳步向好，但仍需关注海外地缘反复及流动性收紧预期带来的扰动。本基金采用动态多因子模型对组合进行管理，因子配置均衡，对于风格约束和风险预算较为严格，力图在中证 1000 指数基准基础上，获取相对稳健的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 09 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.5074 元，份额累计净值为 1.5074 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-14.72%，同期业绩基准增长率-17.15%。

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 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。自 2024 年 11 月 5 日至 2026 年 9 月 30 日，基金管理人自主承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用。

§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	27,190,832.28	92.06
	其中：股票	27,190,832.28	92.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,000.28	0.03
	其中：债券	8,000.28	0.03
	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	1,959,702.77	6.63
8	其他各项资产	378,091.68	1.28
9	合计	29,536,627.01	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	246,825.90	0.85
B	采矿业	429,548.00	1.47
C	制造业	15,599,777.81	53.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	577,249.00	1.98
E	建筑业	260,921.00	0.89
F	批发和零售业	1,320,590.00	4.53
G	交通运输、仓储和邮政业	356,993.13	1.22
H	住宿和餐饮业	116,706.00	0.40
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,451,659.45	8.40
J	金融业	45,105.00	0.15
K	房地产业	379,503.56	1.30
L	租赁和商务服务业	132,450.76	0.45
M	科学研究和技术服务业	588,899.15	2.02
N	水利、环境和公共设施管理业	298,866.00	1.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	40,550.00	0.14

R	文化、体育和娱乐业	173,853.00	0.60
S	综合	46,900.00	0.16
	合计	23,066,397.76	79.06

5.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	106,709.50	0.37
B	采矿业	45,955.00	0.16
C	制造业	2,551,031.02	8.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	92,480.00	0.32
E	建筑业	2,618.00	0.01
F	批发和零售业	405,563.00	1.39
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	378,257.00	1.30
J	金融业	-	-
K	房地产业	318,375.00	1.09
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	119,178.00	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	71,765.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	15,849.00	0.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	16,654.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	4,124,434.52	14.14

5.2.3 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

5.3.1 期末指数投资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	688766	普冉股份	800	285,312.00	0.98
2	600428	中远海特	24,900	266,679.00	0.91
3	300378	鼎捷数智	6,800	255,952.00	0.88
4	601222	林洋能源	43,000	255,420.00	0.88
5	603927	中科软	18,500	252,340.00	0.86
6	603883	老百姓	19,000	247,760.00	0.85
7	002458	益生股份	30,510	246,825.90	0.85
8	002315	焦点科技	9,940	246,611.40	0.85
9	600710	苏美达	21,600	243,648.00	0.84
10	001914	招商积余	25,900	243,460.00	0.83

5.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000989	九芝堂	21,500.00	188,125.00	0.64
2	300917	特发服务	5,300.00	183,115.00	0.63
3	002998	优彩资源	18,700.00	148,665.00	0.51
4	000062	深圳华强	5,900.00	125,788.00	0.43
5	300475	香农芯创	800.00	122,592.00	0.42

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	8,000.28	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	8,000.28	0.03

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123286	国科转债	80	8,000.28	0.03

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

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IM2612	IM2612	1.00	1,435,120.00	-9,640.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-9,640.00
股指期货投资本期收益(元)					-81,271.26
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-131,800.00

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，老百姓大药房连锁股份有限公司在报告编制前一年受到邵阳市武冈市医疗保障局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同约定备选股票库之外的股票。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	258,091.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	120,000.00
7	其他	-
8	合计	378,091.68

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	11,355,790.00
报告期期间基金总申购份额	14,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	6,000,000.00
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	19,355,790.00

§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

投资者	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区	期初份	申购份	赎回份	持有份	份额

类别	号	间	额	额	额	额	占比
机构	1	2026-07-01~2026-07-02;2026-07-13~2026-07-13;2026-07-22~2026-09-10	740,255.00	10,461,200.00	8,231,200.00	2,970,255.00	15.35%
	2	2026-07-07~2026-07-08;2026-07-10~2026-07-13	386,435.00	8,914,500.00	6,714,100.00	2,586,835.00	13.36%
	3	2026-07-01~2026-07-01	2,657,200.00	-	565,200.00	2,092,000.00	10.81%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

注：1.申购份额包含买入份额，赎回份额包含卖出份额。

2.份额占比为四舍五入后的结果。

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。“创造财富，共赴未来”是公司的使命。公司的投资理念是“投资价值发现者”。截至 2026 年 9 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 406 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 16,913 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,744 亿元人民币，累计分红逾 2,335 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中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金设立的文件

2、《博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3、《博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数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、博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本

6、报告期内博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数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

二〇二六年十月二十七日