

博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数 证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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：中信证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

§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。

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 8 月 27 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 2026 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	1
2.1 基金基本情况	1
2.2 基金产品说明	1
2.3 基金管理人和基金托管人	2
2.4 信息披露方式	2
2.5 其他相关资料	2
§3 主要财务指标和基金净值表现	3
3.1 主要会计数据和财务指标	3
3.2 基金净值表现	3
§4 管理人报告	4
4.1 基金管理人及基金经理情况	4
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	6
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	6
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	6
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	7
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	7
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	8
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	8
§5 托管人报告	8
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	8
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	8
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	8
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	8
6.1 资产负债表	9
6.2 利润表	10
6.3 净资产变动表	12
6.4 报表附注	14
§7 投资组合报告	35
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§9 开放式基金份额变动	55

§10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	11,355,790.00 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	2023 年 11 月 10 日

2.2 基金产品说明

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。

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	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	杨军智
	联系电话	0755-83169999	010-60834299
	电子邮箱	service@bosera.com	yjz@citics.com
客户服务电话		95105568	010-60836588
传真		0755-83195140	010-60834004
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	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦5层
邮政编码		518040	100125
法定代表人		张东	张佑君

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://www.bosera.com
基金中期报告置备地点	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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	3,875,391.65
本期利润	4,177,143.98
加权平均基金份额本期利润	0.2752
本期加权平均净值利润率	16.89%
本期基金份额净值增长率	20.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	8,029,534.98
期末可供分配基金份额利润	0.7071
期末基金资产净值	20,071,930.22
期末基金份额净值	1.7676
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	76.76%

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。

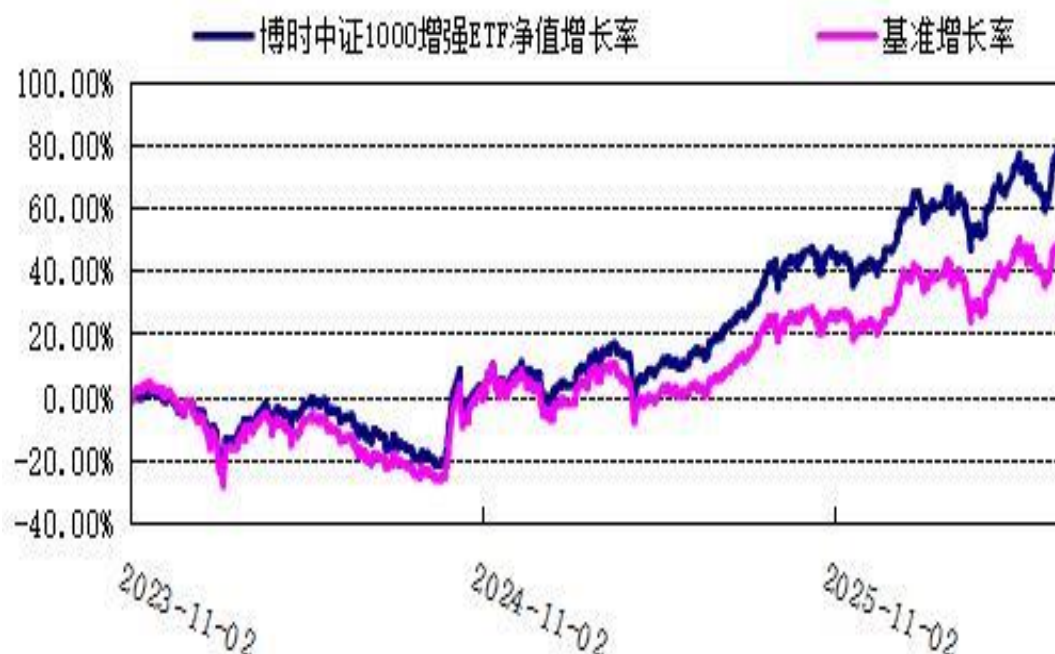
3.2 基金净值表现

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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	16.29%	1.57%	15.62%	1.61%	0.67%	-0.04%
过去六个月	20.54%	1.58%	15.99%	1.62%	4.55%	-0.04%
过去一年	48.34%	1.35%	38.60%	1.38%	9.74%	-0.03%
自基金合同生效起至今	76.76%	1.65%	47.85%	1.72%	28.91%	-0.07%

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”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2026 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 404 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 17,353 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 6,993 亿元人民币，累计分红逾 2,312 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。

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		
杨振建	基金经理	2023-11-02	-	12.8	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 18 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

本报告期内，2026 年上半年 A 股市场呈现“震荡上行、结构分化”的态势，主要指数稳步收涨，市场活力显著增强，行情主线清晰，科技成长板块领涨，人工智能、算力半导体等新质生产力领域表现强劲，市场“含科量”显著提升，上证指数上半年收于 4094 点。海外在地缘局势逐步缓和之后，全球多数权益资产在

年初波动后逐步回稳。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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.7676 元，份额累计净值为 1.7676 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 20.54%，同期业绩基准增长率 15.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年在更加积极有为的宏观政策支持下，中国经济运行总体平稳，出口保持了韧性。宏观政策明确实施“更加积极的财政政策”和“适度宽松的货币政策”，为经济回升向好提供了有力支撑。财政政策保持适度支出强度、持续发行超长期特别国债并支持“两重”“两新”建设，货币政策保持流动性合理充裕，推动社会综合融资成本稳中有降。在此背景下，市场流动性整体充裕，科技成长板块表现相对突出，资源品、红利等板块整体表现相对偏弱。展望下半年，从盈利预期角度看，A 股市场预计将在盈利驱动与政策支持下，市场驱动力将从估值扩张转向企业盈利改善预期。宏观基本面预计在“十五五”开局之年的产业政策与流动性宽松环境中逐步企稳。配置上建议关注上市公司业绩兑现能力与结构性机会的平衡。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。为确保基金估值工作符合以上规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人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、法律合规部负责人、风险管理部负责人、投资部门负责人、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备良好专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制订健全、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，保证基金估值的公平、合理。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金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，当对估值原则及技术存有异议时，本基金托管人有责任要求本基金管理人作出合理解释，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、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相

关债券品种、流通受限股票的估值数据。

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

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。

§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，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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真实、准确和完整发表意见

本报告期，由博时基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关本基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.6.1	1,988,012.43	907,640.94
结算备付金		513,309.31	426,921.31
存出保证金		306,990.09	210,815.94
交易性金融资产	6.4.6.2	18,212,027.44	15,566,384.12
其中：股票投资		18,211,027.41	15,566,384.12
基金投资		-	-
债券投资		1,000.03	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		1,755,390.88	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	120,000.00	150,000.00
资产总计		22,895,730.15	17,261,762.31

负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,792,012.46	0.01
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,799.28	7,182.81
应付托管费		1,959.87	1,436.53
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	4,650.50
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	20,028.32	10,123.20
负债合计		2,823,799.93	23,393.05
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	11,355,790.00	11,755,790.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	8,716,140.22	5,482,579.26
净资产合计		20,071,930.22	17,238,369.26
负债和净资产总计		22,895,730.15	17,261,762.31

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7676 元，基金份额总额 11,355,790.00 份。

6.2 利润表

会计主体：博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026年1月1日至2026 年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30 日
一、营业总收入		4,252,096.27	2,128,968.58
1.利息收入		12,133.09	8,915.48
其中：存款利息收入	6.4.6.9	12,133.09	8,915.48
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,495,815.12	1,648,468.28
其中：股票投资收益	6.4.6.10	3,115,350.68	1,421,362.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.11	0.03	3,216.01
资产支持证券投资收益	6.4.6.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.13	218,279.48	129,344.27
股利收益	6.4.6.14	162,184.93	94,546.00
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）	6.4.6.15	301,752.33	502,507.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	442,395.73	-30,922.64
减：二、营业总支出		74,952.29	41,282.91

1. 管理人报酬		61,731.96	33,834.06
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		12,346.46	6,766.89
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	6.4.6.17	-	-
7. 税金及附加		873.65	678.05
8. 其他费用	6.4.6.18	0.22	3.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,177,143.98	2,087,685.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,177,143.98	2,087,685.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,177,143.98	2,087,685.67

6.3 净资产变动表

会计主体：博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026年1月1日至2026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	11,755,790.00	-	5,482,579.26	17,238,369.26
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	11,755,790.00	-	5,482,579.26	17,238,369.26
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-400,000.00	-	3,233,560.96	2,833,560.96
(一)、综合收益总额	-	-	4,177,143.98	4,177,143.98
(二)、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数(净资产减少以 “-”号填列)	-400,000.00	-	-943,583.02	-1,343,583.02
其中: 1.基金申购款	52,800,000.00	-	32,715,651.67	85,515,651.67
2.基金赎回款	-53,200,000.00	-	-33,659,234.69	-86,859,234.69
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的净资产变动(净 资产减少以“-”号填 列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	11,355,790.00	-	8,716,140.22	20,071,930.22

项目	上年度可比期间			
	2025年1月1日至2025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	12,955,790.00	-	567,948.96	13,523,738.96
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	12,955,790.00	-	567,948.96	13,523,738.96

三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-2,000,000.00	-	1,530,969.85	-469,030.15
(一)、综合收益总额	-	-	2,087,685.67	2,087,685.67
(二)、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数(净资产减少以 “-”号填列)	-2,000,000.00	-	-556,715.82	-2,556,715.82
其中: 1.基金申购款	14,000,000.00	-	1,288,279.29	15,288,279.29
2.基金赎回款	-16,000,000.00	-	-1,844,995.11	-17,844,995.11
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的净资产变动(净 资产减少以“-”号填 列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	10,955,790.00	-	2,098,918.81	13,054,708.81

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：张东，主管会计工作负责人：吴慧峰，会计机构负责人：陈子成

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]658 号准予注册，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 272,955,790.00 元（含所募集股票市值），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2023）

验字第 70019484_A02 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于 2023 年 11 月 2 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 272,955,790.00 份基金份额,无利息折份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司,基金托管人为中信证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2023]246 号核准,本基金于 2023 年 11 月 10 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股(含存托凭证)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金所持有的股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例不低于 80%;投资于标的指数成份股和备选成份股(含存托凭证)的比例不低于非现金基金资产的 80%;本基金在每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;股指期货、股票期权、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 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[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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，

证券交易印花税实施减半征收。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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
活期存款	1,988,012.43
等于：本金	1,987,507.33
加：应计利息	505.10
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	1,988,012.43

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2026年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		17,578,197.85	-	18,211,027.41	632,829.56
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,000.00	0.03	1,000.03	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,000.00	0.03	1,000.03	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		17,579,197.85	0.03	18,212,027.44	632,829.56

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

6.4.6.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末			
	2026 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	1,574,840.00	-	-	-
---股指期货	1,574,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	1,574,840.00	-	-	-
----	--------------	---	---	---

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。

6.4.6.3.2 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
IM2609	IM2609	1.00	1,697,000.00	122,160.00
合计	-	-	-	122,160.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	122,160.00
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.6.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
应收利息	-
其他应收款	120,000.00
待摊费用	-
合计	120,000.00

6.4.6.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026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	20,028.32
其中：交易所市场	20,028.32
银行间市场	-
应付利息	-
合计	20,028.32

6.4.6.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,755,790.00	11,755,790.00
本期申购	52,800,000.00	52,800,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-53,200,000.00	-53,200,000.00
本期末	11,355,790.00	11,355,790.00

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)。

6.4.6.8 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	4,826,918.10	655,661.16	5,482,579.26
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	4,826,918.10	655,661.16	5,482,579.26
本期利润	3,875,391.65	301,752.33	4,177,143.98
本期基金份额交易产生的变	-672,774.77	-270,808.25	-943,583.02

动数			
其中：基金申购款	30,141,139.81	2,574,511.86	32,715,651.67
基金赎回款	-30,813,914.58	-2,845,320.11	-33,659,234.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,029,534.98	686,605.24	8,716,140.22

6.4.6.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	9,247.03
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	2,770.49
其他	115.57
合计	12,133.09

6.4.6.10 股票投资收益

6.4.6.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,205,190.92
股票投资收益——赎回差价收入	910,159.76
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	3,115,350.68

6.4.6.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	104,415,354.26
减：卖出股票成本总额	102,101,166.74
减：交易费用	108,996.60
买卖股票差价收入	2,205,190.92

6.4.6.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	86,859,234.69
减：现金支付赎回款总额	51,161,907.69
减：赎回股票成本总额	34,787,167.24
减：交易费用	-
赎回差价收入	910,159.76

6.4.6.11 债券投资收益

6.4.6.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.03
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	0.03

6.4.6.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

6.4.6.12 资产支持证券投资收益

6.4.6.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.6.12.2 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。

6.4.6.13 衍生工具收益

6.4.6.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.6.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	218,279.48

6.4.6.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	162,184.93
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	162,184.93

6.4.6.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	239,912.33
——股票投资	239,912.33
——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	61,840.00
——权证投资	-
——股指期货	61,840.00
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	301,752.33

6.4.6.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	442,395.73
合计	442,395.73

6.4.6.17 信用减值损失

无发生额。

6.4.6.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	0.22
合计	0.22

注：自 2024 年 11 月 5 日至 2026 年 6 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。

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.7.2 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。

6.4.8 关联方、关联关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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
中信证券	140,733,939.49	66.92%	46,656,571.67	63.17%

6.4.9.1.2 权证交易

无。

6.4.9.1.3 债券交易

无。

6.4.9.1.4 债券回购交易

无。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2026 年 1 月 1 日至 2026 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
中信证券	28,977.99	66.92%	11,286.35	56.35%
关联方名称	上年度可比期间			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 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
中信证券	9,606.95	63.15%	4,057.56	60.14%

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。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	61,731.96	33,834.06
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,328.98	992.74

应支付基金管理人的净管理费	57,402.98	32,841.32
---------------	-----------	-----------

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 0.50% 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 × 0.50% / 当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2026年1月1日至2026年6月 30日	2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	12,346.46	6,766.89

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 当年天数。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.9.4 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

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.9.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
-------	---------------------	-----------------------

	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信证券	386,435.00	3.40%	1,941,535.00	16.52%
招商证券	740,255.00	6.52%	2,865,955.00	24.38%

注：1.除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

2.持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

6.4.9.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10 利润分配情况

无。

6.4.11 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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

6.4.11.1.1 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
118072	鼎通转债	2026-06-24	17 个交易日	新债未上市	100.00	100.00	10.00	1,000.00	1,000.03	-

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

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。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。

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、法律合规部、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；法律合规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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.2.4 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 2026年6月30日	上年末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	1,000.03	-
未评级	-	-
合计	1,000.03	-

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。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.3 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来自调整基金投资组合时，由于组合资产流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用组合证券形式，流动性风险相对较低。

6.4.12.3.1 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%。

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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,988,012.43	-	-	-	1,988,012.43
结算备付金	513,309.31	-	-	-	513,309.31
存出保证金	103,350.09	-	-	203,640.00	306,990.09
交易性金融资产	-	-	1,000.03	18,211,027.41	18,212,027.44
应收清算款	-	-	-	1,755,390.88	1,755,390.88
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	120,000.00	120,000.00
资产总计	2,604,671.83	-	1,000.03	20,290,058.29	22,895,730.15
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	2,792,012.46	2,792,012.46
应付管理人报酬	-	-	-	9,799.28	9,799.28
应付托管费	-	-	-	1,959.87	1,959.87
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	20,028.32	20,028.32
负债总计	-	-	-	2,823,799.93	2,823,799.93
利率敏感度缺口	2,604,671.83	-	1,000.03	17,466,258.36	20,071,930.22
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	907,640.94	-	-	-	907,640.94

结算备付金	426,921.31	-	-	-	426,921.31
存出保证金	32,279.94	-	-	178,536.00	210,815.94
交易性金融资产	-	-	-	15,566,384.12	15,566,384.12
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	-	-	-	150,000.00	150,000.00
资产总计	1,366,842.19	-	-	15,894,920.12	17,261,762.31
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	0.01	0.01
应付管理人报酬	-	-	-	7,182.81	7,182.81
应付托管费	-	-	-	1,436.53	1,436.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	4,650.50	4,650.50
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	10,123.20	10,123.20
负债总计	-	-	-	23,393.05	23,393.05
利率敏感度缺口	1,366,842.19	-	-	15,871,527.07	17,238,369.26

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。

6.4.12.4.1.2 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）。

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 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。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	18,211,027.41	90.73	15,566,384.12	90.30
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,000.03	0.00	-	-
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	18,212,027.44	90.73	15,566,384.12	90.30

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，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为 0。

6.4.12.4.3.2 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 97	增加约 80
	业绩比较基准下降 5%	减少约 97	减少约 80

6.4.13 公允价值

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.13.2.1 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 2026年6月30日
第一层次	18,211,027.41
第二层次	1,000.03
第三层次	-
合计	18,212,027.44

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.4 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。

6.4.14 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	18,211,027.41	79.54
	其中：股票	18,211,027.41	79.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,000.03	0.00
	其中：债券	1,000.03	0.00
	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	2,501,321.74	10.92
8	其他各项资产	2,182,380.97	9.53
9	合计	22,895,730.15	100.00

注：股票投资项包含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	170,263.70	0.85
B	采矿业	332,399.80	1.66
C	制造业	10,540,313.03	52.51

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	128,978.00	0.64
E	建筑业	308,846.04	1.54
F	批发和零售业	521,299.00	2.60
G	交通运输、仓储和邮政业	155,704.34	0.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,727,001.33	8.60
J	金融业	191,973.00	0.96
K	房地产业	409,394.57	2.04
L	租赁和商务服务业	106,370.72	0.53
M	科学研究和技术服务业	166,590.00	0.83
N	水利、环境和公共设施管理业	283,138.00	1.41
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	72,368.00	0.36
S	综合	30,446.00	0.15
	合计	15,145,085.53	75.45

注：上述按行业分类的境内股票投资组合的合计项不包含可退替代款估值增值。

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	60,142.80	0.30
B	采矿业	19,310.00	0.10
C	制造业	2,488,196.00	12.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,528.00	0.04
E	建筑业	43,259.00	0.22

F	批发和零售业	93,428.00	0.47
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	244,081.00	1.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	46,759.00	0.23
L	租赁和商务服务业	19,568.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,650.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,248.00	0.08
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,381.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	3,062,550.80	15.26

7.2.3 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。

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

7.3.1 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	688630	芯碁微装	400	219,756.00	1.09
2	688627	精智达	300	214,500.00	1.07
3	688503	聚和材料	1,300	172,510.00	0.86
4	688110	东芯股份	800	162,960.00	0.81
5	600323	瀚蓝环境	5,800	159,268.00	0.79
6	688766	普冉股份	200	153,320.00	0.76
7	301087	可孚医疗	3,150	150,097.50	0.75
8	688321	微芯生物	5,687	149,738.71	0.75
9	600502	安徽建工	33,300	144,855.00	0.72

10	002557	洽洽食品	8,000	143,680.00	0.72
11	688025	杰普特	300	141,000.00	0.70
12	300438	鹏辉能源	1,700	140,845.00	0.70
13	688146	中船特气	400	139,996.00	0.70
14	000778	新兴铸管	36,200	134,302.00	0.67
15	688388	嘉元科技	3,025	133,100.00	0.66
16	603317	天味食品	10,000	130,100.00	0.65
17	002043	兔宝宝	11,500	127,420.00	0.63
18	600037	歌华有线	20,200	126,654.00	0.63
19	688559	海目星	1,500	125,880.00	0.63
20	300678	中科信息	5,600	125,440.00	0.62
21	688127	蓝特光学	1,263	123,268.80	0.61
22	603588	高能环境	6,400	122,880.00	0.61
23	000636	风华高科	1,700	122,808.00	0.61
24	001914	招商积余	14,200	115,872.00	0.58
25	688519	南亚新材	300	114,012.00	0.57
26	688779	五矿新能	13,666	110,831.26	0.55
27	603638	艾迪精密	4,700	110,215.00	0.55
28	688536	思瑞浦	300	109,227.00	0.54
29	300738	奥飞数据	5,400	109,188.00	0.54
30	002458	益生股份	13,810	107,303.70	0.53
31	688167	炬光科技	300	106,263.00	0.53
32	300098	高新兴	22,700	104,193.00	0.52
33	600641	先导基电	2,600	103,636.00	0.52
34	000650	仁和药业	20,100	102,309.00	0.51
35	003010	若羽臣	4,200	102,060.00	0.51
36	603083	剑桥科技	400	101,948.00	0.51
37	001287	中电港	3,200	99,680.00	0.50
38	301487	盟固利	5,200	99,580.00	0.50
39	688372	伟测科技	534	99,324.00	0.49
40	002170	芭田股份	8,700	94,482.00	0.47
41	002378	章源钨业	2,800	93,744.00	0.47
42	688327	云从科技	7,471	93,088.66	0.46
43	688048	长光华芯	185	92,870.00	0.46
44	002222	福晶科技	1,000	92,280.00	0.46
45	688063	派能科技	1,700	90,559.00	0.45
46	300184	力源信息	5,100	89,505.00	0.45
47	300672	国科微	300	88,500.00	0.44
48	688208	道通科技	3,487	87,837.53	0.44
49	301511	德福科技	600	86,310.00	0.43
50	002961	瑞达期货	4,400	86,152.00	0.43
51	300034	钢研高纳	5,000	85,700.00	0.43
52	600971	恒源煤电	12,400	85,560.00	0.43
53	300573	兴齐眼药	2,090	85,188.40	0.42

54	002484	江海股份	800	84,000.00	0.42
55	002701	奥瑞金	19,200	81,792.00	0.41
56	605376	博迁新材	300	81,390.00	0.41
57	002091	江苏国泰	11,200	80,976.00	0.40
58	002315	焦点科技	3,440	80,083.20	0.40
59	600064	南京高科	11,189	79,777.57	0.40
60	002151	北斗星通	2,500	79,375.00	0.40
61	600572	康恩贝	20,200	79,184.00	0.39
62	300236	上海新阳	600	78,900.00	0.39
63	301031	中熔电气	659	78,717.55	0.39
64	002416	爱施德	8,700	77,952.00	0.39
65	601208	东材科技	1,100	77,869.00	0.39
66	600266	城建发展	19,900	77,809.00	0.39
67	001339	智微智能	750	76,710.00	0.38
68	600428	中远海特	9,800	76,538.00	0.38
69	688668	鼎通科技	200	74,660.00	0.37
70	300323	华灿光电	3,600	73,440.00	0.37
71	002192	融捷股份	800	71,520.00	0.36
72	600577	精达股份	7,300	71,394.00	0.36
73	301219	腾远钴业	1,280	70,144.00	0.35
74	002400	省广集团	11,100	70,041.00	0.35
75	601677	明泰铝业	4,200	69,720.00	0.35
76	688097	博众精工	1,100	69,355.00	0.35
77	301345	涛涛车业	300	69,300.00	0.35
78	600072	中船科技	8,096	68,735.04	0.34
79	600388	龙净环保	4,700	68,385.00	0.34
80	605123	派克新材	700	67,907.00	0.34
81	688548	广钢气体	1,300	67,730.00	0.34
82	600869	远东股份	2,000	66,940.00	0.33
83	600867	通化东宝	8,300	66,732.00	0.33
84	301396	宏景科技	200	66,320.00	0.33
85	688158	优刻得	1,800	66,168.00	0.33
86	301217	铜冠铜箔	400	66,028.00	0.33
87	002245	蔚蓝锂芯	3,520	65,859.20	0.33
88	600686	金龙汽车	5,800	65,482.00	0.33
89	300503	昊志机电	700	64,610.00	0.32
90	300773	拉卡拉	4,220	64,566.00	0.32
91	600201	生物股份	5,500	64,075.00	0.32
92	300613	富瀚微	800	64,064.00	0.32
93	600320	振华重工	15,500	64,015.00	0.32
94	002497	雅化集团	3,100	63,147.00	0.31
95	002041	登海种业	8,000	62,960.00	0.31
96	688409	富创精密	200	61,250.00	0.31
97	603127	昭衍新药	1,600	61,152.00	0.30

98	600206	有研新材	900	59,940.00	0.30
99	600750	华润江中	2,700	59,589.00	0.30
100	605599	菜百股份	4,300	58,910.00	0.29
101	000973	佛塑科技	4,100	58,835.00	0.29
102	600787	中储股份	14,000	58,520.00	0.29
103	002545	东方铁塔	3,600	58,392.00	0.29
104	000612	焦作万方	5,500	58,245.00	0.29
105	688195	腾景科技	300	57,774.00	0.29
106	300008	天海防务	9,500	57,570.00	0.29
107	603124	江南新材	300	56,094.00	0.28
108	000685	中山公用	5,000	55,800.00	0.28
109	688262	国芯科技	1,269	54,858.87	0.27
110	603929	亚翔集成	200	54,404.00	0.27
111	601222	林洋能源	10,000	53,200.00	0.27
112	688400	凌云光	800	52,960.00	0.26
113	300568	星源材质	2,800	52,416.00	0.26
114	301571	国科天成	800	52,144.00	0.26
115	000550	江铃汽车	3,200	51,904.00	0.26
116	600961	株冶集团	1,600	51,824.00	0.26
117	000829	天音控股	6,500	50,700.00	0.25
118	601126	四方股份	800	50,560.00	0.25
119	688717	艾罗能源	600	49,542.00	0.25
120	300398	飞凯材料	800	49,400.00	0.25
121	002354	天娱数科	5,300	49,290.00	0.25
122	002745	木林森	3,900	48,945.00	0.24
123	688300	联瑞新材	200	48,880.00	0.24
124	002747	埃斯顿	1,300	48,529.00	0.24
125	300457	赢合科技	2,300	48,484.00	0.24
126	688362	甬矽电子	500	48,200.00	0.24
127	002428	云南锗业	400	48,072.00	0.24
128	000762	西藏矿业	1,800	48,060.00	0.24
129	002636	金安国纪	400	47,988.00	0.24
130	002389	航天彩虹	2,700	47,979.00	0.24
131	000681	视觉中国	2,400	47,856.00	0.24
132	000719	中原传媒	4,000	45,720.00	0.23
133	688392	骄成超声	200	45,436.00	0.23
134	688088	虹软科技	1,272	45,219.60	0.23
135	000811	冰轮环境	800	44,976.00	0.22
136	300806	斯迪克	400	44,800.00	0.22
137	301589	诺瓦星云	300	44,694.00	0.22
138	002859	洁美科技	400	43,804.00	0.22
139	301216	万凯新材	1,900	43,681.00	0.22
140	688390	固德威	400	43,404.00	0.22
141	688368	晶丰明源	200	43,304.00	0.22

142	603013	亚普股份	2,700	42,633.00	0.21
143	688102	斯瑞新材	900	42,462.00	0.21
144	688032	禾迈股份	500	42,260.00	0.21
145	688700	东威科技	468	41,839.20	0.21
146	688205	德科立	200	41,638.00	0.21
147	603678	火炬电子	500	41,500.00	0.21
148	000880	潍柴重机	1,800	41,418.00	0.21
149	300925	法本信息	2,800	41,412.00	0.21
150	603496	恒为科技	1,800	41,364.00	0.21
151	600667	太极实业	1,400	40,852.00	0.20
152	300855	图南股份	1,300	40,638.00	0.20
153	000899	赣能股份	4,200	40,572.00	0.20
154	000682	东方电子	3,200	40,416.00	0.20
155	603516	淳中科技	300	40,383.00	0.20
156	002338	奥普光电	700	40,040.00	0.20
157	002737	葵花药业	3,500	39,235.00	0.20
158	301510	固高科技	1,200	38,316.00	0.19
159	300342	天银机电	800	37,600.00	0.19
160	002345	潮宏基	4,100	37,597.00	0.19
161	000049	德赛电池	1,600	37,392.00	0.19
162	000969	安泰科技	1,500	36,810.00	0.18
163	002838	道恩股份	1,200	36,744.00	0.18
164	001337	四川黄金	1,000	36,660.00	0.18
165	000917	电广传媒	5,400	36,126.00	0.18
166	300602	飞荣达	700	35,840.00	0.18
167	603026	石大胜华	400	35,748.00	0.18
168	688531	日联科技	200	35,568.00	0.18
169	688690	纳微科技	800	35,280.00	0.18
170	603305	旭升集团	2,900	35,148.00	0.18
171	600186	莲花控股	2,500	35,000.00	0.17
172	688031	星环科技	300	34,554.00	0.17
173	300409	道氏技术	1,700	33,881.00	0.17
174	600596	新安股份	2,100	33,516.00	0.17
175	601777	千里科技	4,100	33,456.00	0.17
176	688380	中微半导	500	32,955.00	0.16
177	301489	思泉新材	200	32,916.00	0.16
178	000712	锦龙股份	3,700	32,782.00	0.16
179	600226	亨通股份	3,400	32,606.00	0.16
180	600246	万通发展	1,700	32,300.00	0.16
181	002216	三全食品	2,800	32,284.00	0.16
182	300166	东方国信	1,800	31,878.00	0.16
183	605196	华通线缆	1,200	31,320.00	0.16
184	603093	南华期货	1,700	30,855.00	0.15
185	603556	海兴电力	1,400	30,800.00	0.15

186	002326	永太科技	1,300	30,745.00	0.15
187	000581	威孚高科	1,800	30,636.00	0.15
188	000833	粤桂股份	1,300	30,446.00	0.15
189	300685	艾德生物	1,800	30,312.00	0.15
190	002716	湖南白银	3,700	29,933.00	0.15
191	605111	新洁能	300	29,742.00	0.15
192	600633	浙数文化	2,900	29,522.00	0.15
193	300772	运达股份	2,400	29,520.00	0.15
194	603992	松霖科技	900	29,160.00	0.15
195	600531	豫光金铅	1,900	28,044.00	0.14
196	301071	力量钻石	300	27,750.00	0.14
197	300762	上海瀚讯	600	27,390.00	0.14
198	600120	浙江东方	6,300	27,090.00	0.13
199	603132	金徽股份	1,700	26,486.00	0.13
200	601069	西部黄金	1,200	26,400.00	0.13
201	603876	鼎胜新材	1,000	26,010.00	0.13
202	688549	中巨芯	700	25,767.00	0.13
203	688003	天准科技	200	25,460.00	0.13
204	600710	苏美达	2,500	23,900.00	0.12
205	600662	外服控股	5,900	23,777.00	0.12
206	301500	飞南资源	900	23,445.00	0.12
207	688382	益方生物	1,300	23,400.00	0.12
208	688353	华盛锂电	200	23,214.00	0.12
209	002922	伊戈尔	700	22,960.00	0.11
210	300170	汉得信息	1,500	22,860.00	0.11
211	300031	宝通科技	800	22,856.00	0.11
212	002947	恒铭达	300	22,815.00	0.11
213	002832	比音勒芬	1,100	22,704.00	0.11
214	002985	北摩高科	800	22,160.00	0.11
215	000534	万泽股份	800	21,888.00	0.11
216	002250	联化科技	1,600	21,872.00	0.11
217	603025	大豪科技	1,600	21,824.00	0.11
218	002171	楚江新材	1,600	21,712.00	0.11
219	002292	奥飞娱乐	3,200	20,992.00	0.10
220	300319	麦捷科技	700	20,741.00	0.10
221	300607	拓斯达	500	20,615.00	0.10
222	688543	国科军工	520	20,514.00	0.10
223	300814	中富电路	100	20,450.00	0.10
224	300153	科泰电源	900	20,358.00	0.10
225	300861	美畅股份	800	20,152.00	0.10
226	000810	创维数字	1,500	19,875.00	0.10
227	600158	中体产业	2,900	19,546.00	0.10
228	002755	奥赛康	1,400	19,068.00	0.09
229	300131	英唐智控	1,000	19,030.00	0.09

230	002063	远光软件	3,700	18,870.00	0.09
231	000552	甘肃能化	8,400	18,816.00	0.09
232	002895	川恒股份	600	17,520.00	0.09
233	301389	隆扬电子	200	17,358.00	0.09
234	000902	新洋丰	1,500	17,340.00	0.09
235	603508	思维列控	800	17,088.00	0.09
236	300726	宏达电子	200	16,914.00	0.08
237	300376	易事特	3,300	16,896.00	0.08
238	300468	四方精创	800	16,808.00	0.08
239	688106	金宏气体	400	16,592.00	0.08
240	301339	通行宝	1,600	16,368.00	0.08
241	600552	凯盛科技	500	16,290.00	0.08
242	002364	中恒电气	300	16,140.00	0.08
243	002405	四维图新	2,400	15,528.00	0.08
244	603267	鸿远电子	200	15,496.00	0.08
245	600330	天通股份	500	15,420.00	0.08
246	300693	盛弘股份	300	14,625.00	0.07
247	600155	华创云信	2,600	14,352.00	0.07
248	600490	鹏欣资源	2,400	13,968.00	0.07
249	688107	安路科技	300	13,680.00	0.07
250	002516	旷达科技	2,400	13,392.00	0.07
251	002246	北化股份	700	13,160.00	0.07
252	002768	国恩股份	248	12,910.88	0.06
253	600057	厦门象屿	2,316	12,552.72	0.06
254	605020	永和股份	300	12,216.00	0.06
255	002588	史丹利	1,500	11,850.00	0.06
256	301095	广立微	100	11,805.00	0.06
257	300049	福瑞医科	300	11,664.00	0.06
258	600916	中国黄金	1,700	11,628.00	0.06
259	002563	森马服饰	2,300	11,592.00	0.06
260	601975	招商南油	3,000	11,190.00	0.06
261	301005	超捷股份	100	11,156.00	0.06
262	002233	塔牌集团	1,600	11,152.00	0.06
263	603039	泛微网络	300	10,821.00	0.05
264	300443	金雷股份	500	10,790.00	0.05
265	001267	汇绿生态	200	10,700.00	0.05
266	605118	力鼎光电	300	10,467.00	0.05
267	603306	华懋科技	100	10,369.00	0.05
268	603826	坤彩科技	400	10,224.00	0.05
269	000930	中粮科技	2,400	10,200.00	0.05
270	301662	宏工科技	100	10,132.00	0.05
271	605099	共创草坪	300	9,660.00	0.05
272	603162	海通发展	1,052	9,436.44	0.05
273	000680	山推股份	900	9,045.00	0.05

274	000950	重药控股	1,800	9,018.00	0.04
275	002541	鸿路钢构	500	8,660.00	0.04
276	300130	新国都	400	8,416.00	0.04
277	000506	招金黄金	700	8,204.00	0.04
278	002906	华阳集团	300	7,488.00	0.04
279	300085	银之杰	200	6,994.00	0.03
280	300827	上能电气	200	6,158.00	0.03
281	300416	苏试试验	300	6,114.00	0.03
282	603533	掌阅科技	300	6,087.00	0.03
283	002270	华明装备	300	5,655.00	0.03
284	002243	力合科创	800	5,256.00	0.03
285	300322	硕贝德	200	5,040.00	0.03
286	601801	皖新传媒	1,000	4,930.00	0.02
287	002498	汉缆股份	700	4,774.00	0.02
288	600353	旭光电子	100	4,560.00	0.02
289	301275	汉朔科技	100	4,490.00	0.02
290	300657	弘信电子	100	4,402.00	0.02
291	688182	灿勤科技	100	4,307.00	0.02
292	000688	国城矿业	100	3,423.00	0.02
293	603888	新华网	200	3,406.00	0.02
294	603730	岱美股份	300	3,351.00	0.02
295	603319	美湖股份	100	3,321.00	0.02
296	600508	上海能源	440	3,242.80	0.02
297	300770	新媒股份	100	3,149.00	0.02
298	300687	赛意信息	100	3,100.00	0.02
299	002276	万马股份	300	3,033.00	0.02
299	600267	海正药业	300	3,033.00	0.02
300	603279	景津装备	200	2,400.00	0.01
301	000603	盛达资源	100	2,310.00	0.01
302	601900	南方传媒	200	2,172.00	0.01
303	301665	泰禾股份	100	2,096.00	0.01
304	301551	无线传媒	100	1,973.00	0.01
305	601918	新集能源	200	1,718.00	0.01
306	603327	福蓉科技	200	1,696.00	0.01
307	600761	安徽合力	100	1,636.00	0.01
308	000848	承德露露	200	1,480.00	0.01
309	600273	嘉化能源	200	1,304.00	0.01
310	002324	普利特	100	1,207.00	0.01
311	301175	中科环保	200	990.00	0.00
312	300047	天源迪科	100	888.00	0.00
313	002004	华邦健康	200	786.00	0.00
314	600643	爱建集团	200	742.00	0.00
315	002511	中顺洁柔	100	665.00	0.00
316	600269	赣粤高速	5	19.90	0.00

7.3.2 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	688498	源杰科技	145.00	273,470.00	1.36
2	300590	移为通信	9,300.00	133,455.00	0.66
3	688525	佰维存储	200.00	98,946.00	0.49
4	002111	威海广泰	10,700.00	96,300.00	0.48
5	603986	兆易创新	100.00	81,500.00	0.41
6	688059	华锐精密	400.00	79,884.00	0.40
7	300681	英搏尔	2,700.00	77,274.00	0.38
8	688045	必易微	900.00	72,702.00	0.36
9	603444	吉比特	200.00	71,684.00	0.36
10	000933	神火股份	3,100.00	65,720.00	0.33
11	000938	紫光股份	2,200.00	63,492.00	0.32
12	300475	香农芯创	200.00	60,000.00	0.30
13	002414	高德红外	4,500.00	59,670.00	0.30
14	301607	富特科技	1,100.00	57,475.00	0.29
15	000951	中国重汽	2,900.00	56,579.00	0.28
16	001218	丽臣实业	2,500.00	55,150.00	0.27
17	688308	欧科亿	300.00	54,543.00	0.27
18	300042	朗科科技	700.00	53,319.00	0.27
19	002558	巨人网络	1,900.00	52,364.00	0.26
20	688275	万润新能	400.00	51,020.00	0.25
21	603061	金海通	100.00	50,222.00	0.25
22	300857	协创数据	140.00	47,586.00	0.24
23	000036	华联控股	10,700.00	46,759.00	0.23
24	688221	前沿生物	2,059.00	46,121.60	0.23
25	688416	恒烁股份	320.00	44,800.00	0.22
26	600768	宁波富邦	2,700.00	40,446.00	0.20
27	688155	先惠技术	500.00	40,445.00	0.20
28	301358	湖南裕能	500.00	37,935.00	0.19
29	688309	恒誉环保	600.00	36,528.00	0.18
30	688266	泽璟制药	300.00	34,998.00	0.17
31	002805	丰元股份	1,200.00	34,308.00	0.17
32	300769	德方纳米	500.00	33,250.00	0.17
33	002772	众兴菌业	2,900.00	32,944.00	0.16
34	688002	睿创微纳	200.00	30,938.00	0.15
35	688257	新锐股份	300.00	30,570.00	0.15
36	688530	欧莱新材	300.00	29,070.00	0.14
37	603991	领先股份	200.00	28,230.00	0.14
38	300037	新宙邦	300.00	27,855.00	0.14
39	002271	东方雨虹	2,300.00	27,301.00	0.14

40	000792	盐湖股份	900.00	27,171.00	0.14
41	002709	天赐材料	500.00	25,715.00	0.13
42	300970	华绿生物	1,310.00	23,946.80	0.12
43	300490	华自科技	1,800.00	23,814.00	0.12
44	688378	奥来德	380.00	23,560.00	0.12
45	002487	大金重工	400.00	23,188.00	0.12
46	603507	振江股份	700.00	23,023.00	0.11
47	603045	福达合金	300.00	21,417.00	0.11
48	600463	空港股份	2,800.00	21,364.00	0.11
49	002517	恺英网络	1,300.00	21,125.00	0.11
50	300975	商络电子	400.00	20,700.00	0.10
51	002033	丽江股份	2,500.00	20,650.00	0.10
52	300953	震裕科技	140.00	18,718.00	0.09
53	603906	龙蟠科技	700.00	18,571.00	0.09
54	002240	盛新锂能	400.00	17,932.00	0.09
55	688633	星球石墨	600.00	17,838.00	0.09
56	300283	温州宏丰	800.00	16,440.00	0.08
57	605098	行动教育	300.00	16,248.00	0.08
58	600203	福日电子	1,300.00	15,795.00	0.08
59	301201	诚达药业	400.00	14,544.00	0.07
60	002842	翔鹭钨业	300.00	14,460.00	0.07
61	688231	隆达股份	390.00	14,324.70	0.07
62	300432	富临精工	700.00	14,063.00	0.07
63	300397	天和防务	900.00	13,626.00	0.07
64	300608	思特奇	1,300.00	13,377.00	0.07
65	000807	云铝股份	600.00	13,284.00	0.07
66	001313	粤海饲料	1,800.00	12,762.00	0.06
67	000062	深圳华强	400.00	12,728.00	0.06
68	688239	航宇科技	200.00	11,966.00	0.06
69	301189	奥尼电子	200.00	11,786.00	0.06
70	605289	罗曼股份	80.00	11,600.00	0.06
71	300540	蜀道装备	300.00	11,370.00	0.06
72	600487	亨通光电	100.00	10,934.00	0.05
73	605117	德业股份	100.00	10,618.00	0.05
74	600755	厦门国贸	1,900.00	10,298.00	0.05
75	603316	诚邦股份	500.00	10,295.00	0.05
76	300302	同有科技	200.00	10,234.00	0.05
77	000426	兴业银锡	300.00	9,888.00	0.05
78	000657	中钨高新	100.00	9,572.00	0.05
79	600382	广东明珠	1,400.00	9,422.00	0.05
80	002606	大连电瓷	700.00	9,387.00	0.05
81	300390	天华新能	100.00	9,351.00	0.05
82	002115	三维通信	900.00	9,270.00	0.05
83	301122	采纳股份	300.00	8,823.00	0.04

84	002297	博云新材	300.00	8,697.00	0.04
85	603700	宁水集团	700.00	8,127.00	0.04
86	002039	黔源电力	400.00	7,528.00	0.04
87	301360	荣旗科技	100.00	6,849.00	0.03
88	002448	中原内配	500.00	6,150.00	0.03
89	300073	当升科技	100.00	4,804.00	0.02
90	300889	爱克股份	200.00	4,466.00	0.02
91	002645	华宏科技	140.00	3,851.40	0.02
92	300291	百纳千成	700.00	3,381.00	0.02
93	600598	北大荒	300.00	3,252.00	0.02
94	301172	君逸数码	100.00	2,595.00	0.01
95	300072	海新能科	300.00	1,020.00	0.01
96	000925	众合科技	100.00	934.00	0.00
97	002367	康力电梯	100.00	691.00	0.00
98	603889	新澳股份	30.00	153.30	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	001309	德明利	1,023,352.00	5.94
2	301031	中熔电气	1,020,192.24	5.92
3	000778	新兴铸管	908,296.00	5.27
4	000650	仁和药业	901,196.00	5.23
5	300573	兴齐眼药	837,488.00	4.86
6	002170	芭田股份	836,988.00	4.86
7	002373	千方科技	806,333.26	4.68
8	002701	奥瑞金	786,296.00	4.56
9	300438	鹏辉能源	754,349.00	4.38
10	000422	湖北宜化	728,748.00	4.23
11	002895	川恒股份	724,973.00	4.21
12	002004	华邦健康	721,540.00	4.19
13	300098	高新兴	699,604.00	4.06
14	300045	华力创通	696,660.00	4.04
15	002039	黔源电力	685,920.00	3.98
16	000059	华锦股份	676,865.00	3.93
17	002414	高德红外	671,942.00	3.90
18	300475	香农芯创	662,500.00	3.84
19	002345	潮宏基	660,713.00	3.83
20	002405	四维图新	652,847.00	3.79

21	001914	招商积余	646,713.00	3.75
22	002043	兔宝宝	636,885.00	3.69
23	002985	北摩高科	636,533.00	3.69
24	300184	力源信息	615,610.00	3.57
25	300738	奥飞数据	604,573.00	3.51
26	300678	中科信息	598,637.00	3.47
27	000555	神州信息	578,461.00	3.36
28	002897	意华股份	574,313.00	3.33
29	002747	埃斯顿	573,503.00	3.33
30	002941	新疆交建	561,276.00	3.26
31	002051	中工国际	558,058.00	3.24
32	300171	东富龙	555,244.00	3.22
33	002091	江苏国泰	552,751.00	3.21
34	301487	盟固利	539,501.00	3.13
35	688498	源杰科技	520,310.00	3.02
36	300861	美畅股份	508,242.00	2.95
37	300008	天海防务	505,906.00	2.93
38	300296	利亚德	501,644.00	2.91
39	000915	华特达因	498,257.00	2.89
40	000589	贵州轮胎	497,121.00	2.88
41	002315	焦点科技	495,893.00	2.88
42	002612	朗姿股份	490,705.00	2.85
43	001337	四川黄金	488,701.00	2.83
44	002588	史丹利	485,239.00	2.81
45	300357	我武生物	482,965.00	2.80
46	000028	国药一致	481,552.00	2.79
47	300492	华图山鼎	475,506.00	2.76
48	301219	腾远钴业	474,082.00	2.75
49	301087	可孚医疗	473,802.00	2.75
50	002222	福晶科技	470,540.00	2.73
51	300681	英搏尔	466,812.00	2.71
52	000600	建投能源	465,991.00	2.70
53	002487	大金重工	439,868.00	2.55
54	002649	博彦科技	438,269.00	2.54
55	002216	三全食品	430,602.00	2.50
56	300773	拉卡拉	422,046.00	2.45
57	300602	飞荣达	420,994.00	2.44
58	301607	富特科技	417,926.00	2.42
59	000917	电广传媒	411,253.00	2.39
60	300409	道氏技术	402,828.00	2.34
61	000990	诚志股份	401,594.00	2.33
62	002378	章源钨业	400,090.00	2.32
63	300693	盛弘股份	398,527.00	2.31
64	002151	北斗星通	394,680.00	2.29

65	300620	光库科技	393,423.00	2.28
66	300483	首华燃气	391,689.00	2.27
67	002716	湖南白银	390,112.00	2.26
68	301153	中科江南	389,682.00	2.26
69	002396	星网锐捷	388,682.00	2.25
70	688766	普冉股份	386,692.59	2.24
71	300775	三角防务	385,139.00	2.23
72	300548	长芯博创	374,875.00	2.17
73	600502	安徽建工	373,285.00	2.17
74	000848	承德露露	366,678.00	2.13
75	301339	通行宝	361,849.00	2.10

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	688498	源杰科技	1,326,258.85	7.69
2	001309	德明利	1,305,605.00	7.57
3	301031	中熔电气	1,161,214.00	6.74
4	000778	新兴铸管	887,196.00	5.15
5	002170	芭田股份	868,681.00	5.04
6	300573	兴齐眼药	866,666.00	5.03
7	000650	仁和药业	830,586.00	4.82
8	002039	黔源电力	826,573.00	4.79
9	002895	川恒股份	813,864.00	4.72
10	300045	华力创通	806,260.00	4.68
11	000059	华锦股份	797,973.00	4.63
12	002373	千方科技	782,876.00	4.54
13	300438	鹏辉能源	774,517.00	4.49
14	002897	意华股份	768,068.00	4.46
15	002701	奥瑞金	764,946.00	4.44
16	000422	湖北宜化	741,223.00	4.30
17	300475	香农芯创	702,945.00	4.08
18	002941	新疆交建	691,452.00	4.01
19	001337	四川黄金	688,926.00	4.00
20	300098	高新兴	679,433.00	3.94
21	002414	高德红外	675,845.00	3.92
22	002004	华邦健康	675,638.00	3.92
23	002985	北摩高科	659,650.40	3.83
24	300184	力源信息	659,285.00	3.82
25	300861	美畅股份	644,133.00	3.74

26	002043	兔宝宝	620,996.00	3.60
27	000555	神州信息	615,240.00	3.57
28	000600	建投能源	607,883.00	3.53
29	002051	中工国际	606,665.00	3.52
30	002747	埃斯顿	606,664.02	3.52
31	002612	朗姿股份	600,968.00	3.49
32	002345	潮宏基	597,895.00	3.47
33	300357	我武生物	596,395.00	3.46
34	002405	四维图新	573,041.00	3.32
35	300738	奥飞数据	567,958.00	3.29
36	300008	天海防务	567,187.00	3.29
37	300620	光库科技	566,153.00	3.28
38	000589	贵州轮胎	562,249.00	3.26
39	000915	华特达因	555,178.00	3.22
40	000990	诚志股份	550,667.00	3.19
41	002222	福晶科技	549,268.00	3.19
42	300171	东富龙	542,560.00	3.15
43	002588	史丹利	540,835.00	3.14
44	002487	大金重工	540,032.00	3.13
45	300548	长芯博创	530,036.00	3.07
46	300681	英搏尔	528,510.00	3.07
47	001914	招商积余	528,014.00	3.06
48	300602	飞荣达	527,430.00	3.06
49	300492	华图山鼎	515,662.00	2.99
50	300296	利亚德	493,105.00	2.86
51	002716	湖南白银	484,778.00	2.81
52	002396	星网锐捷	474,131.00	2.75
53	300775	三角防务	472,058.00	2.74
54	301607	富特科技	468,787.00	2.72
55	000028	国药一致	468,761.00	2.72
56	300693	盛弘股份	465,264.00	2.70
57	002649	博彦科技	456,678.00	2.65
58	300678	中科信息	456,224.00	2.65
59	300409	道氏技术	449,047.00	2.60
60	000603	盛达资源	444,273.00	2.58
61	002091	江苏国泰	442,317.00	2.57
62	000848	承德露露	428,108.00	2.48
63	301381	赛维时代	424,617.00	2.46
64	002315	焦点科技	423,586.00	2.46
65	301219	腾远钴业	422,207.00	2.45
66	301606	绿联科技	413,681.00	2.40
67	002690	美亚光电	410,598.00	2.38
68	002518	科士达	409,435.00	2.38
69	300850	新强联	407,902.00	2.37

70	300483	首华燃气	407,023.00	2.36
71	002216	三全食品	403,367.00	2.34
72	301487	盟固利	403,022.00	2.34
73	002378	章源钨业	402,836.00	2.34
74	301511	德福科技	398,608.00	2.31
75	002993	奥海科技	394,811.00	2.29
76	688766	普冉股份	392,738.00	2.28
77	301153	中科江南	381,900.00	2.22
78	688097	博众精工	366,589.09	2.13
79	002511	中顺洁柔	360,469.00	2.09
80	603383	顶点软件	357,919.00	2.08
81	000917	电广传媒	351,848.00	2.04
82	300772	运达股份	348,678.70	2.02
83	688200	华峰测控	348,640.35	2.02

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	105,888,805.07
卖出股票的收入（成交）总额	104,415,354.26

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）	1,000.03	0.00

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,000.03	0.00

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	118072	鼎通转债	10	1,000.03	0.00

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。

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	306,990.09
2	应收清算款	1,755,390.88
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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,182,380.97

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

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
325	34,940.89	7,803,490.00	68.72%	3,552,300.00	31.28%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

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

- 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（2023 年 11 月 2 日）基金份额总额	272,955,790.00
本报告期期初基金份额总额	11,755,790.00
本报告期基金总申购份额	52,800,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	53,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	11,355,790.00

§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 2026 年 02 月 14 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》，张东先生代任公司首席信息官，王德英先生离任公司副总经理、公司首席信息官。

本报告期内，本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

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期无涉及基金财产的诉讼。

本报告期内无其他涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

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 2024 年起改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人没有受到监管部门的调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员没有受到监管部门的调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
-----	------	------	-----------	----

称	数量	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	
中信证券	3	140,733,939.49	66.92%	28,977.99	66.92%	-
广发证券	2	33,692,414.69	16.02%	6,937.04	16.02%	增加 2 个
光大证券	1	35,877,805.15	17.06%	7,388.56	17.06%	-

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序

(1) 本公司根据法规要求制定《博时基金公募基金证券交易佣金分配管理办法》，明确选择证券公司参与证券交易的标准和程序，并建立证券公司的准入管理机制，符合筛选标准的证券公司可纳入公司证券公司白名单库，并持续动态管理。

(2) 本公司选择证券公司参与证券交易的主要标准是财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。严禁基金销售业务人员参与证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

(3) 本公司依据上述标准进行评估并确定证券公司，与其签订交易单元租用协议或证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过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
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

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	博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金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	2026-06-26
2	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新	中国证券报、基金管理人	2026-06-12

	增华鑫证券为申购、赎回代办券商的公告	网站、证监会基金电子披露网站	
3	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增西南证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-03
4	博时基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-05-29
5	关于博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-05-28
6	2025 年度博时基金以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-30
7	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 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	2026-04-22
8	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31
9	博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 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	2026-03-31
10	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增瑞银证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-25
11	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-26
12	博时基金管理有限公司关于以通讯方式召开博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-25
13	博时基金管理有限公司关于以通讯方式召开博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-24
14	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	2026-02-14
15	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增中国国际金融股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-13
16	博时基金管理有限公司关于以通讯方式召开博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披	2026-02-13

	券投资基金基金份额持有人大会的公告	露网站	
17	博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数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	2026-02-09
18	博时基金管理有限公司关于调整博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金最小申购、赎回单位的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-06
19	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	2026-02-04
20	博时基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-02
21	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-20260124	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-24
22	博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 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	2026-01-22

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026-06-30~2026-06-30	-	2,657,200.00	-	2,657,200.00	23.40%
	2	2026-04-17~2026-04-27;2026-04-29~2026-05-06	203,600.00	24,668,700.00	23,601,100.00	1,271,200.00	11.19%
	3	2026-01-01~2026-01-06;2026-01-09~2026-04-16;2026-04-28~2026-	2,86	58,86	60,99	740,	6.

		04-28;2026-05-07~2026-05-10;2026-05-12~2026-05-13;2026-05-15~2026-06-14;2026-06-26~2026-06-29	5,95 5.00	5,600 .00	1,300 .00	255. 00	52 %
		2026-01-07~2026-01-08;2026-01-16~2026-01-19;2026-01-21~2026-01-21;2026-01-28~2026-01-28;2026-02-24~2026-02-24	1,94 1,53 5.00	34,81 6,100 .00	36,37 1,200 .00	386, 435. 00	3. 40 %
4							
5		2026-01-01~2026-01-11	2,67 6,60 0.00	- - -	2,676 ,600. 00	- - -	- - -

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。

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

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

二〇二六年八月三十一日