

博时稳合一年持有期混合型证券投资基金

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：广发银行股份有限公司

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。

基金托管人广发银行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	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
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	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	62
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	62
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	62
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	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62

7.12 本报告期投资基金情况	63
7.13 投资组合报告附注	63
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 盈利投资者数量占比	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	66
§9 开放式基金份额变动	66
§10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	67
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	67
10.8 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	67
10.9 其他重大事件	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时稳合一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	博时稳合一年持有期混合	
基金主代码	019712	
交易代码	019712	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 4 月 17 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	广发银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	337,391,548.19 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时稳合一年持有期混合 A	博时稳合一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	019712	019713
报告期末下属分级基金的份额总额	103,346,785.00 份	234,044,763.19 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争实现组合资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金的大类资产配置策略主要是基于对宏观经济周期运行规律的研究予以决策，根据经济周期决定股票资产和债券资产的投资比例。本基金将通过跟踪宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及国家财政、税收、货币、汇率各项政策，来判断经济周期目前的位置以及未来发展方向。在经济周期各阶段，综合对各类宏观经济指标和市场指标的分析，进行大类资产配置。通过股票和债券的配置，并通过量化多策略体系的量化择时和量化选股策略，从而控制基金回撤风险，力争实现组合资产长期稳健的增值。其他资产投资策略有股票投资策略、债券等固定收益类资产投资策略、金融衍生品投资策略、基金投资策略、

	参与融资业务的投资策略等。
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率×75%+国证 2000 指数收益率×10%+中证可转换债券指数收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

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	广发银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	顾洪峰
	联系电话	0755-83169999	010-65169885
	电子邮箱	service@bosera.com	guhongfeng@cgbchina.com.cn
客户服务电话		95105568	4008308003
传真		0755-83195140	010-65169555
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	广东省广州市越秀区东风东路 713 号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区金融大街十五号鑫茂大厦北楼 4 层
邮政编码		518040	100032
法定代表人		张东	林朝晖

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告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	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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	博时稳合一年持有期混 合 A	博时稳合一年持有期 混合 C
本期已实现收益	5,691,113.36	12,510,591.34
本期利润	5,206,385.68	10,932,481.84
加权平均基金份额本期利润	0.0431	0.0393
本期加权平均净值利润率	3.96%	3.63%
本期基金份额净值增长率	4.18%	4.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	博时稳合一年持有期混 合 A	博时稳合一年持有期 混合 C
期末可供分配利润	9,342,626.57	19,890,931.48
期末可供分配基金份额利润	0.0904	0.0850
期末基金资产净值	112,689,411.57	253,935,694.67
期末基金份额净值	1.0904	1.0850
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	博时稳合一年持有期混 合 A	博时稳合一年持有期 混合 C
基金份额累计净值增长率	19.55%	18.76%

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

博时稳合一年持有期混合 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
过去三个月	5.36%	0.49%	2.60%	0.24%	2.76%	0.25%
过去六个月	4.18%	0.45%	3.29%	0.26%	0.89%	0.19%
过去一年	9.94%	0.38%	6.02%	0.21%	3.92%	0.17%
自基金合同生效起至今	19.55%	0.36%	16.42%	0.23%	3.13%	0.13%

博时稳合一年持有期混合 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
过去三个月	5.29%	0.49%	2.60%	0.24%	2.69%	0.25%
过去六个月	4.02%	0.45%	3.29%	0.26%	0.73%	0.19%
过去一年	9.62%	0.38%	6.02%	0.21%	3.60%	0.17%
自基金合同生效起至今	18.76%	0.36%	16.42%	0.23%	2.34%	0.13%

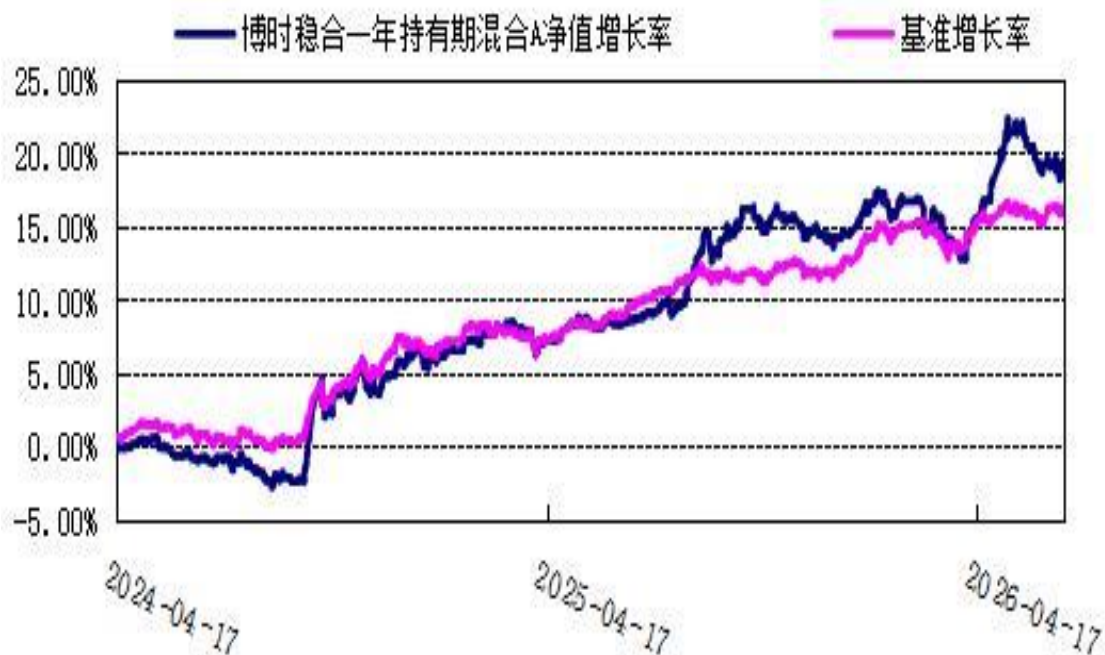
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时稳合一年持有期混合型证券投资基金

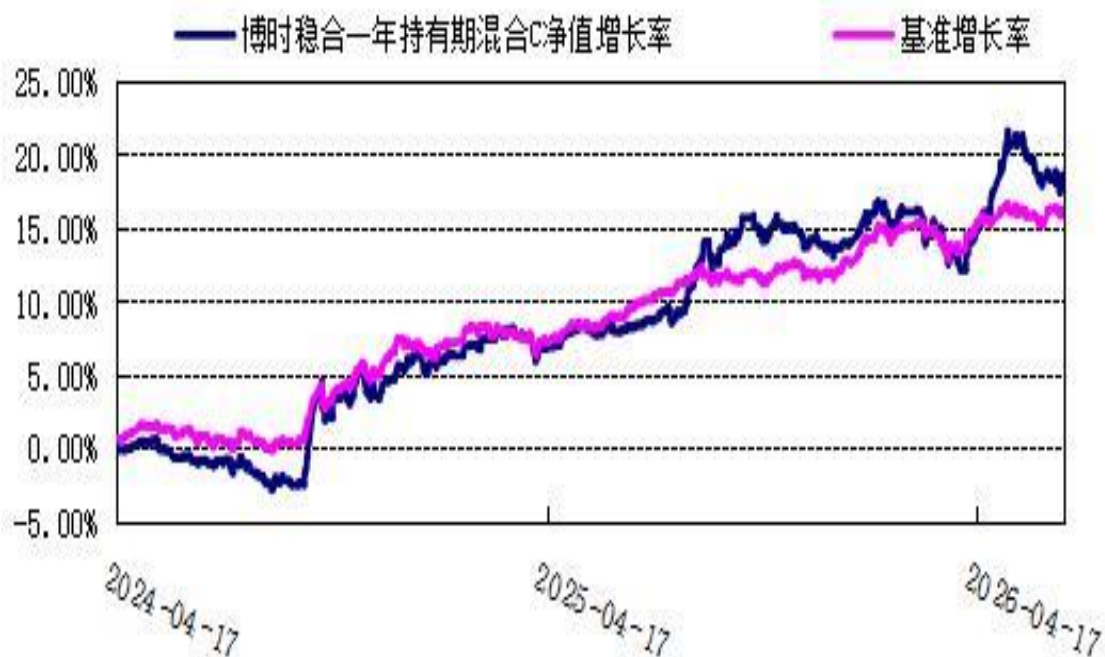
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2024 年 4 月 17 日至 2026 年 6 月 30 日)

博时稳合一年持有期混合 A



博时稳合一年持有期混合 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		
罗霄	基金经理	2024-04-17	-	13.9	罗霄先生，硕士。2012 年加入博时基金管理有限公司。历任固定收益部研究员、固定收益总部高级研究员、固定收益总部高级研究员兼基金经理助理、年金投资部投资经理、博时恒康一年持有期混合型证券投资基金(2023 年 3 月 1 日-2023 年 7 月 27 日)、博时荣升稳健添利 18 个月定期开放混合型证券投资基金(2023 年 3 月 23 日-2025 年 3 月 13 日)、博时恒瑞混合型证券投资基金(2023 年 9 月 15 日-2025 年 10 月 25 日)的基金经理。现任博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）(2022 年 9 月 30 日—至今)、博时稳定价值债券投资基金(2023 年 7 月 28 日—至今)、博时稳健增利债券型证券投资基金(2023 年 10 月 20 日—至今)、博时宏观回报债券型证券投资基金(2024 年 2 月 2 日—至今)、博时天颐债券型证券投资

					资基金(2024 年 2 月 2 日—至今)、博时恒进 6 个月持有期混合型证券投资基金(2024 年 2 月 2 日—至今)、博时恒鑫稳健一年持有期混合型证券投资基金(2024 年 2 月 2 日—至今)、博时稳合一年持有期混合型证券投资基金(2024 年 4 月 17 日—至今)、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金(2025 年 4 月 15 日—至今)的基金经理。
刘钊	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2024-04-17	-	19.8	刘钊先生，博士。2006 年起先后在深圳证券交易所、五矿证券、摩根士丹利华鑫基金、深圳知方石投资有限公司工作。2020 年加入博时基金管理有限公司。曾任博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日-2024 年 7 月 10 日)基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2020 年 12 月 23 日—至今)、博时智选量化多因子股票型证券投资基金(2021 年 11 月 2 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 2 月 13 日—至今)、博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金(2023 年 3 月 31 日—至今)、博时稳合一年持有期混合型证券投资基金(2024 年 4 月 17 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

2026 年上半年，海内外权益市场整体呈现先抑后扬、极致结构化分化特征。

海外，中东地缘冲突是上半年核心外部扰动。伊朗地缘冲突爆发推升国际油价大幅上行，打破市场美联储降息预期，甚至引发加息定价，全球风险偏好显著回落。目前市场对 2026 年下半年的预期是一到两次加息，幅度在 0.25% 到 0.5% 之间。

国内宏观经济整体处于政策托底、市场筑底修复阶段，上半年国内持续实施积极财政叠加适度宽松货币的双宽松政策，通过全年 4% 左右赤字率、超长期特别国债与专项债发力夯实基建底盘，叠加汽车、家电、智能数码等领域以旧换新消费补贴提振内需，有效对冲外部输入性通胀、地缘冲击及产业分化带来的下行压力；货币政策持续保持流动性合理充裕，加强财政货币协同、压降实体融资成本、助力产业转型升级，政策托底成效持续落地，6 月制造业 PMI、非制造业商务活动指数、综合 PMI 产出指数分别录得 50.3%、50.2%、50.6%，三大指标全线站稳荣枯线上方，供需同步回暖，经济景气水平稳步修复。

产业方面，大 AI 产业链较为突出。一季度开源 AI 智能体框架“龙虾”（OpenClaw）快速普及，低门槛、开源开放的特性打破行业发展壁垒，带动算力、存储等 AI 硬件需求大幅扩容，AI 全产业链景气度全面激活，为科技板块提供持续结构性机会。二季度 AI 产业景气度进一步向高端赛道集中，

结构性分化加剧。但随着 HBM 高端存储需求爆发，头部晶圆厂优先保障算力订单、压降成熟制程产能，挤压手机、PC 等消费电子芯片供给。上游零部件涨价推升终端成本，叠加居民消费意愿偏弱，消费电子及下游传统行业需求持续走弱，形成 AI 算力上游高景气、终端消费偏弱的割裂格局。

在上述背景下，A 股行业表现较为分化。整个上半年，全市场仅 9 个中信一级行业上涨。其中，电子、通信行业断崖式领先，分别上涨 85.49%、74.54%，建材、基础化工、机械亦录得两位数涨幅，分别为 43.7%、18.56%、16.17%，其它上涨行业涨幅仅为个位数。21 个行业下跌。消费者服务、综合金融、综合、农林牧渔、商贸零售跌幅居前，涨跌幅分别为-31.88%、-29.58%、-25.09%、-24.76%、-22.18%。行业首尾收益差超 120%。宽基方面，依托 AI 产业爆发行情，科创 50 上涨 64.25%，科创 100 上涨 62.07%。沪深 300、中证 500、中证 1000 分别上涨 7.55%、20.97%、15.99%。港股表现偏弱，恒生指数、恒生科技指数分别下跌 10.73%、18.92%。

债券方面，2026 年上半年，债券市场整体延续区间震荡特征。基本面层面，制造业 PMI 回升，出口链景气改善，但内需、地产链条修复有限。通胀方面，物价温和上涨，通胀压力有限。资金面方面，上半年央行通过多轮 MLF、逆回购操作持续呵护流动性，收益率曲线进一步趋平。债券市场方面，中短端债券收益率表现更稳，高评级信用债与二级资本债利差进一步压缩，配置需求旺盛。整体来看，结构性资产配置机会贯穿上半年，中端久期、AAA 信用债表现相对占优。票息资产收益成为组合收益的重要来源，久期灵活调整成为对抗市场波动的核心手段。

本基金在一季度维持了常规的策略配置，但在二季度，考虑到本基金的偏低风险偏好，为了降低净值回撤风险，我们战略性的调低了小市值因子的暴露，调高了大市值模型和主观选股的比例。

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 A 类基金份额净值为 1.0904 元，份额累计净值为 1.1886 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0850 元，份额累计净值为 1.1812 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 4.18%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 4.02%，同期业绩基准增长率为 3.29%。

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，股市方面，考虑到流动性层面，海外加息预期已充分定价，下半年全球流动性收紧压力边际缓解，利好权益估值修复。国内财政与货币政策持续协同，消费、基建政策红利持续释放，内需复苏动能稳步增强，为市场提供基本面支撑。产业层面，AI 智能体、高端算力、先进制造等新质生产力赛道景气度延续上行，仍是市场核心主线；传统行业随经济复苏逐步修复，市场结构性分化有望逐步收敛。

需要指出的是，随着基本面的结构性复苏，量化基金有可能面临主动选股的挑战，小市值因子

不断集聚的风险也将进一步被凸显。因此，我们在平衡配置各量化策略的基础上，将继续降低小盘策略的配置比例，突出主观能动性，根据量化因子的选股逻辑，结合政策指引和演绎推理，强化部分个股的配置权重。

债市方面，宏观环境外需支撑下仍有韧性，内需缺乏大幅上行动力，债券市场或将继续维持区间震荡格局。新旧动能转换、货币政策保持稳健宽松等支持利率低位运行的核心结构性力量没有根本变化，资金面预计持续温和，短端收益率下行空间有限，收益核心仍以票息为主。与此同时，超长期国债、地方债等供给压力持续，长端利率波动风险仍需关注。外部风险主要为海外地缘事件及美债收益率波动，可能阶段性冲击市场情绪。投资配置方面，依然关注期限结构调整和工具化管理，可优先布局中等期限高信用等级信用债，同时根据供给扰动灵活配置长端国债和资产荒驱动的结构机会。票息资产依旧是基础配置，组合层面将持续动态调整资产配置，把握波段机会，积极应对潜在市场波动。

总之，本基金将在控制风险的前提下，采用量化与主观相结合的科学分析方法，争取持续跑赢业绩基准，并尽量控制最大回撤。

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

本基金管理人于 2026 年 3 月 6 日发布公告，以 2026 年 2 月 27 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.5000 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.5000 元人民币。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对博时稳合一年持有期混合型证券投资基金（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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、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地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时稳合一年持有期混合型证券投资基金

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	10,501,136.88	3,444,042.27
结算备付金		12,799,851.09	8,323,585.36
存出保证金		263,744.14	238,359.35
交易性金融资产	6.4.6.2	192,900,535.83	409,272,927.79
其中：股票投资		92,770,158.68	99,659,734.67
基金投资		49,360.00	23,420.00
债券投资		100,081,017.15	309,589,773.12
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	100,000,000.00	75,581,744.38
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		51,098,707.33	9,607,802.28
应收股利		-	-
应收申购款		1,349.42	7,059.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	-	-
资产总计		367,565,324.69	506,475,520.82
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		-	8,211,921.15
应付赎回款		368,058.51	1,603,501.95
应付管理人报酬		181,565.15	253,804.85
应付托管费		45,391.26	63,451.20
应付销售服务费		62,951.12	88,789.78
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,653.51	5,499.71
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	278,598.90	293,701.85
负债合计		940,218.45	10,520,670.49
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	337,391,548.19	453,336,960.86
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	29,233,558.05	42,617,889.47
净资产合计		366,625,106.24	495,954,850.33
负债和净资产总计		367,565,324.69	506,475,520.82

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 337,391,548.19 份。其中 A 类基金份额净值 1.0904 元，基金份额总额 103,346,785.00 份；C 类基金份额净值 1.0850 元，基金份额总额 234,044,763.19 份。

6.2 利润表

会计主体：博时稳合一年持有期混合型证券投资基金

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		18,383,683.19	13,249,437.45
1.利息收入		365,999.52	877,479.17
其中：存款利息收入	6.4.6.9	38,800.18	46,102.18
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		327,199.34	831,376.99
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,080,520.85	23,817,115.34
其中：股票投资收益	6.4.6.10	16,764,530.74	16,940,033.88
基金投资收益	6.4.6.11	2,025.99	-
债券投资收益	6.4.6.12	2,420,584.50	5,875,449.73
资产支持证券投资收益	6.4.6.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.14	-	788.08
股利收益	6.4.6.15	893,379.62	1,000,843.65
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）	6.4.6.16	-2,062,837.18	-11,445,157.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	-	-
减：二、营业总支出		2,244,815.67	2,957,145.95
1. 管理人报酬		1,292,971.35	1,774,457.14
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		323,296.85	443,614.29

3. 销售服务费		450,439.59	636,764.31
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		66,659.14	3,801.03
其中：卖出回购金融资产支出		66,659.14	3,801.03
6. 信用减值损失	6.4.6.19	-	-
7. 税金及附加		3,588.59	3,045.54
8. 其他费用	6.4.6.20	107,860.15	95,463.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,138,867.52	10,292,291.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,138,867.52	10,292,291.50
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		16,138,867.52	10,292,291.50

6.3 净资产变动表

会计主体：博时稳合一年持有期混合型证券投资基金

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	453,336,960.86	-	42,617,889.47	495,954,850.33
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	453,336,960.86	-	42,617,889.47	495,954,850.33

三、本期增减变动 额（减少以“-”号填 列）	-115,945,412.67	-	-13,384,331.42	-129,329,744.09
（一）、综合收益总 额	-	-	16,138,867.52	16,138,867.52
（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）	-115,945,412.67	-	-7,531,731.52	-123,477,144.19
其中：1.基金申购款	21,033,477.99	-	1,983,222.16	23,016,700.15
2.基金赎回款	-136,978,890.66	-	-9,514,953.68	-146,493,844.34
（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）	-	-	-21,991,467.42	-21,991,467.42
（四）、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资 产	337,391,548.19	-	29,233,558.05	366,625,106.24

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	611,947,231.77	-	38,775,152.99	650,722,384.76
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	611,947,231.77	-	38,775,152.99	650,722,384.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-211,940,782.99	-	-23,686,889.02	-235,627,672.01
（一）、综合收益总额	-	-	10,292,291.50	10,292,291.50
（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）	-211,940,782.99	-	-4,812,625.06	-216,753,408.05
其中：1.基金申购款	119,846,883.45	-	4,616,468.23	124,463,351.68
2.基金赎回款	-331,787,666.44	-	-9,429,093.29	-341,216,759.73
（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）	-	-	-29,166,555.46	-29,166,555.46
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	400,006,448.78	-	15,088,263.97	415,094,712.75

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

博时稳合一年持有期混合型证券投资基金（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]2233 号《关于准予博时稳合一年持有期混合型证券投资基金募集的批复》核准，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《博时稳合一年持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 608,344,090.52 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2024）验字第 70019484_A08 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时稳合一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2024 年 4 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 608,634,500.48 份基金份额，其中认购资金利息折合 290,409.96 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为广发银行股份有限公司。

本基金对每份基金份额设置一年的最短持有期。对于每份认购份额的最短持有期起始日指基金合同生效日，对于每份申购份额的最短持有期起始日指该基金份额申购申请的确认日；最短持有期到期日指该基金份额最短持有期起始日起一年后的对应日。如无此对应日期或该对应日为非工作日，则顺延至下一工作日。在每份基金份额的最短持有期到期日前（不含当日），基金份额持有人不能对该基金份额提出赎回申请。

根据《博时稳合一年持有期混合型证券投资基金基金合同》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时稳合一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换债券、公开发行的次级债等）、国内经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（不含香港互认基金、QDII 基金、FOF 基金、可投基金的非 FOF 基金和货币市场基金）、资产支持证券、国债期货、股指期货、

股票期权、信用衍生品、同业存单、债券回购、货币市场工具、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资业务。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金对权益类资产及可转换债券、可交换债券的投资合计占基金资产的 10%-30%，本基金投资的权益类资产包括股票（含存托凭证）及权益类证券投资基金。本基金投资于可转换债券及可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%。本基金投资的权益类证券投资基金包括股票型基金以及至少满足以下一条标准的混合型基金：（1）基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于 60%；（2）基金最近 4 期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于 60%。本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金投资比例不超过基金资产的 10%。本基金投资同业存单的比例不超过基金资产的 20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约、国债期货合约所需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率×75%+ 国证 2000 指数收益率×10%+中证可转换债券指数收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》，以及中国证券投资基金业协会颁布的《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》和中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

（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‰，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；

根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2） 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号文《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号文《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，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，继续免征增值税直至债券到期；

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》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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% 的规定征收率计算缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）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；

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。

（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。

（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。

6.4.6 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	10,501,136.88
等于：本金	10,500,873.75
加：应计利息	263.13
减：坏账准备	-
定期存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	10,501,136.88

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		95,272,980.21	-	92,770,158.68	-2,502,821.53
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	40,012,834.48	159,824.70	40,291,453.86	118,794.68
	银行间市场	59,488,663.56	90,563.29	59,789,563.29	210,336.44
	合计	99,501,498.04	250,387.99	100,081,017.15	329,131.12
资产支持证券		-	-	-	-
基金		10,736.52	-	49,360.00	38,623.48

其他	-	-	-	-
合计	194,785,214.77	250,387.99	192,900,535.83	-2,135,066.93

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

无余额。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	100,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	100,000,000.00	-

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

无余额。

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	120,038.75

其中：交易所市场	117,638.75
银行间市场	2,400.00
应付利息	-
预提费用	158,560.15
合计	278,598.90

6.4.6.7 实收基金

博时稳合一年持有期混合 A

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	账面金额
上年度末	136,853,592.88	136,853,592.88
本期申购	8,485,213.06	8,485,213.06
本期赎回（以“-”号填列）	-41,992,020.94	-41,992,020.94
本期末	103,346,785.00	103,346,785.00

博时稳合一年持有期混合 C

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	账面金额
上年度末	316,483,367.98	316,483,367.98
本期申购	12,548,264.93	12,548,264.93
本期赎回（以“-”号填列）	-94,986,869.72	-94,986,869.72
本期末	234,044,763.19	234,044,763.19

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

博时稳合一年持有期混合 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	13,044,777.11	165,966.94	13,210,744.05
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	13,044,777.11	165,966.94	13,210,744.05
本期利润	5,691,113.36	-484,727.68	5,206,385.68
本期基金份额交易产生的变动数	-2,254,090.39	-288,210.98	-2,542,301.37
其中：基金申购款	719,674.45	117,069.77	836,744.22
基金赎回款	-2,973,764.84	-405,280.75	-3,379,045.59
本期已分配利润	-6,532,201.79	-	-6,532,201.79
本期末	9,949,598.29	-606,971.72	9,342,626.57

博时稳合一年持有期混合 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	29,011,895.02	395,250.40	29,407,145.42
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	29,011,895.02	395,250.40	29,407,145.42
本期利润	12,510,591.34	-1,578,109.50	10,932,481.84
本期基金份额交易产生的变动数	-4,816,891.03	-172,539.12	-4,989,430.15
其中：基金申购款	975,836.06	170,641.88	1,146,477.94
基金赎回款	-5,792,727.09	-343,181.00	-6,135,908.09
本期已分配利润	-15,459,265.63	-	-15,459,265.63
本期末	21,246,329.70	-1,355,398.22	19,890,931.48

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	8,416.01
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	29,902.70
其他	481.47
合计	38,800.18

6.4.6.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	340,222,210.88
减：卖出股票成本总额	322,941,626.42
减：交易费用	516,053.72
买卖股票差价收入	16,764,530.74

6.4.6.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	157,799.70
减：卖出/赎回基金成本总额	155,700.00
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	61.16
减：交易费用	12.55
基金投资收益	2,025.99

6.4.6.12 债券投资收益

6.4.6.12.1 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	2,276,792.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	143,791.85
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	2,420,584.50

6.4.6.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	283,929,881.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	280,876,381.95
减：应计利息总额	2,907,247.78
减：交易费用	2,460.19
买卖债券差价收入	143,791.85

6.4.6.13 资产支持证券投资收益

6.4.6.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.6.13.2 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。

6.4.6.14 衍生工具收益

6.4.6.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.6.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

6.4.6.15 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	893,379.62
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	893,379.62

6.4.6.16 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	-2,061,990.97
——股票投资	-4,034,571.95
——债券投资	1,946,640.98
——资产支持证券投资	-
——基金投资	25,940.00
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的	846.21

预估增值税	
合计	-2,062,837.18

6.4.6.17 其他收入

无发生额。

6.4.6.18 持有基金产生的费用

项目	本期
	2026年1月1日至2026年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	127.10
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	32.63

注：上述当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费，是根据被投资基金的实际持仓情况和被投资基金的基金合同约定费率估算得出。该三项费用根据被投资基金的基金合同约定已经作为费用计入被投资基金的基金份额净值，已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用。

6.4.6.19 信用减值损失

无发生额。

6.4.6.20 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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
中债登账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,600.00
合计	107,860.15

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、注册登记机构
广发银行股份有限公司（“广发银行”）	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。

6.4.9 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

无。

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,292,971.35	1,774,457.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	582,390.74	796,928.28
应支付基金管理人的净管理费	710,580.61	977,528.86

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额

0.60%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扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额×0.60%/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	323,296.85	443,614.29

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额 0.15%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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额×0.15%/当年天数。

6.4.9.2.3 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		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时稳合一年持有 期混合 A	博时稳合一年持有期混 合 C	合计
招商证券	-	2,223.29	2,223.29
广发银行	-	420,092.58	420,092.58
博时基金	-	321.76	321.76
合计	-	422,637.63	422,637.63
获得销售服务费的各 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		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时稳合一年持有	博时稳合一年持有期混	合计

	期混合 A	合 C	
招商证券	-	99.60	99.60
广发银行	-	636,484.96	636,484.96
博时基金	-	3.41	3.41
合计	-	636,587.97	636,587.97

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 0.30% 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：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.30% / 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

单位：人民币元

本期						
2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
广发银行股 份有限公司	39,421,708.49	-	-	-	-	-
上年度可比期间						
2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

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

无。

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

单位：人民币元

关联方名称	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发银行-活期存款	10,501,136.88	8,416.01	53,508,924.91	11,117.60

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。

6.4.9.7 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					
2026 年 1 月 1 日至 2026 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	920186	中科仪	北交所网下新股中签	48,000.00	778,080.00
上年度可比期间					
2025 年 1 月 1 日至 2025 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	001388	信通电子	网下发行	937.00	15,385.54

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。

6.4.9.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	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
当期交易基金产生的申购费 (元)	-	-
当期交易基金产生的赎回费 (元)	-	-
当期持有基金产生的应支付销 售服务费 (元)	-	-
当期持有基金产生的应支付管 理费 (元)	54.04	-
当期持有基金产生的应支付托 管费 (元)	18.02	-
当期交易基金产生的交易费 (元)	12.55	-

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。

根据本基金合同的约定，本基金基金财产中投资于本基金管理人管理的其他基金份额的部分不收取管理费，本基金基金财产中投资于本基金托管人托管的其他基金份额的部分不收取托管费。本基金管理人运用本基金财产申购其自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由本基金管理人直接减免，相关销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还。故当期交易基金产生的申购费为零，当期交易基金产生的赎回费 0.00 元仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。

6.4.10 利润分配情况

博时稳合一年持有期混合 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日 (场外)	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发 放总额	再投资形式 发放总额	利润分配合 计	备注
1	2026-03-10	2026-03-10	0.5000	6,240,151.98	292,049.81	6,532,201.79	-
合计			0.5000	6,240,151.98	292,049.81	6,532,201.79	-

博时稳合一年持有期混合 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日 (场外)	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发 放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
1	2026-03-10	2026-03-10	0.5000	14,741,881.55	717,384.08	15,459,265.63	-
合计			0.5000	14,741,881.55	717,384.08	15,459,265.63	-

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：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
300750	宁德时代	2026-04-24	6 个月	非 公 开 发 行 限 售	410.34	373.17	19,600.00	8,042,664.00	7,314,132.00	-

688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	首次公开发行限售	104.66	768.89	1,332.00	139,407.12	1,024,161.48	-
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	首次公开发行限售	46.08	463.33	723.00	33,315.84	334,987.59	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	首次公开发行限售	22.68	42.16	4,367.00	99,043.56	184,112.72	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	首次公开发行限售	9.47	70.14	1,478.00	13,996.66	103,666.92	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	首次公开发行限售	44.56	468.67	160.00	7,129.60	74,987.20	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	首次公开	69.66	160.06	452.00	31,486.32	72,347.12	-

				发行 限售						
688712	北 芯 生 命	2026-01-28	6 个 月	首次公 开发 行 限 售	17.52	35.92	1,500.00	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒 运 昌	2026-01-20	6 个 月	首次公 开发 行 限 售	92.18	463.15	116.00	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰 金 新 能	2026-03-24	6 个 月	首次公 开发 行 限 售	26.28	172.09	234.00	6,149.52	40,269.06	-
001257	盛 龙 股 份	2026-03-24	6 个 月	首次公 开发 行 限 售	7.82	20.74	1,743.00	13,630.26	36,149.82	-
603459	红 板 科 技	2026-03-31	6 个 月	首次公 开发 行 限 售	17.70	84.32	317.00	5,610.90	26,729.44	-

688811	有研复材	2026-04-01	6 个月	首次公开发 行限售	6.41	24.13	834.00	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	首次公开发 行限售	24.68	86.80	216.00	5,330.88	18,748.80	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	首次公开发 行限售	21.93	77.78	195.00	4,276.35	15,167.10	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	首次公开发 行限售	58.00	112.16	117.00	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	首次公开发 行限售	78.38	121.77	96.00	7,524.48	11,689.92	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	首次公开	55.95	57.10	177.00	9,903.15	10,106.70	-

				发行 限售						
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	首次公开发 行限售	11.18	17.59	445.00	4,975.10	7,827.55	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	首次公开发 行限售	26.66	50.96	138.00	3,679.08	7,032.48	-
920136	永励精密	2026-06-25	10 个交易日	新股未上市	19.28	19.28	300.00	5,784.00	5,784.00	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	首次公开发 行限售	21.88	25.52	112.00	2,450.56	2,858.24	-
920193	吉和昌	2026-06-18	9 个交易日	新股未上市	8.52	8.52	300.00	2,556.00	2,556.00	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	首次公开发 行	18.38	16.78	134.00	2,462.92	2,248.52	-

				限售						
920189	康 美 特	2026-06-30	6 个 交 易 日	新 股 未 上 市	8.14	8.14	200.00	1,628.00	1,628.00	-
603284	林 平 发 展	2026-02-03	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	37.88	34.87	46.00	1,742.48	1,604.02	-

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。

6.4.11.2 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

本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的前提下，力争实现组合资产长期稳健的增值。

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。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	20,129,638.36	26,156,783.56
合计	20,129,638.36	26,156,783.56

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。

6.4.12.2.2 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	39,448,213.70	-
合计	39,448,213.70	-

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	30,430,667.40	112,916,067.29
AAA 以下	629.20	21,910,436.98
未评级	10,071,868.49	148,606,485.29
合计	40,503,165.09	283,432,989.56

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约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。

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.4 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	10,501,136.88	-	-	-	10,501,136.88
结算备付金	12,799,851.09	-	-	-	12,799,851.09
存出保证金	263,744.14	-	-	-	263,744.14
交易性金融资产	69,665,728.77	30,414,659.18	629.20	92,819,518.68	192,900,535.83
应收清算款	-	-	-	51,098,707.33	51,098,707.33
买入返售金融资产	100,000,000.00	-	-	-	100,000,000.00
应收申购款	-	-	-	1,349.42	1,349.42
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	193,230,460.88	30,414,659.18	629.20	143,919,575.43	367,565,324.69
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	368,058.51	368,058.51
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	181,565.15	181,565.15
应付托管费	-	-	-	45,391.26	45,391.26
应付销售服务费	-	-	-	62,951.12	62,951.12
应交税费	-	-	-	3,653.51	3,653.51
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	278,598.90	278,598.90
负债总计	-	-	-	940,218.45	940,218.45
利率敏感度缺口	193,230,460.88	30,414,659.18	629.20	142,979,356.98	366,625,106.24
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	3,444,042.27	-	-	-	3,444,042.27
结算备付金	8,323,585.36	-	-	-	8,323,585.36
存出保证金	238,359.35	-	-	-	238,359.35
交易性金融资产	47,207,691.37	174,483,529.61	87,898,552.14	99,683,154.67	409,272,927.79
应收清算款	-	-	-	9,607,802.28	9,607,802.28
买入返售金融资产	75,581,744.38	-	-	-	75,581,744.38
应收申购款	-	-	-	7,059.39	7,059.39
应收股利	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	134,795,422.73	174,483,529.61	87,898,552.14	109,298,016.34	506,475,520.82
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,603,501.95	1,603,501.95
应付清算款	-	-	-	8,211,921.15	8,211,921.15
应付管理人报酬	-	-	-	253,804.85	253,804.85
应付托管费	-	-	-	63,451.20	63,451.20
应付销售服务费	-	-	-	88,789.78	88,789.78
应交税费	-	-	-	5,499.71	5,499.71
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	293,701.85	293,701.85
负债总计	-	-	-	10,520,670.49	10,520,670.49
利率敏感度缺口	134,795,422.73	174,483,529.61	87,898,552.14	98,777,345.85	495,954,850.33

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

假设	除市场利率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
	市场利率上升 25 个基点	减少约 32	减少约 395
	市场利率下降 25 个基点	增加约 33	增加约 410

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	92,770,158.68	25.30	99,659,734.67	20.09
交易性金融资产—基金投资	49,360.00	0.01	23,420.00	0.00
交易性金融资产—债券投资	629.20	0.00	1,986,785.91	0.40
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	92,820,147.88	25.32	101,669,940.58	20.50

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 410	增加约 2,111
	业绩比较基准下降 5%	减少约 410	减少约 2,111

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	83,380,500.66
第二层次	100,090,355.95
第三层次	9,429,679.22
合计	192,900,535.83

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；对于处于封闭期的基金投资，本基金不会将相关基金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	92,770,158.68	25.24
	其中：股票	92,770,158.68	25.24
2	基金投资	49,360.00	0.01
3	固定收益投资	100,081,017.15	27.23
	其中：债券	100,081,017.15	27.23
	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	100,000,000.00	27.21
	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	23,300,987.97	6.34
8	其他各项资产	51,363,800.89	13.97
9	合计	367,565,324.69	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	6,998.00	0.00
B	采矿业	6,292,401.82	1.72
C	制造业	41,533,646.11	11.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,899,470.00	0.52
E	建筑业	16,844.00	0.00
F	批发和零售业	56,579.00	0.02

G	交通运输、仓储和邮政业	10,488,055.00	2.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,341,721.22	3.37
J	金融业	18,057,418.45	4.93
K	房地产业	9,500.00	0.00
L	租赁和商务服务业	1,544,180.08	0.42
M	科学研究和技术服务业	5,355.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	509,850.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,580.00	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,560.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	92,770,158.68	25.30

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	300750	宁德时代	25,000	9,436,386.00	2.57
2	601021	春秋航空	156,300	7,124,154.00	1.94
3	601318	中国平安	143,600	6,855,464.00	1.87
4	605499	东鹏饮料	51,400	6,344,302.00	1.73
5	600938	中国海油	230,400	6,255,360.00	1.71
6	688279	峰昭科技	25,414	5,703,918.16	1.56
7	301606	绿联科技	92,900	5,668,758.00	1.55
8	688018	乐鑫科技	34,189	4,373,456.88	1.19
9	600030	中信证券	149,765	4,302,748.45	1.17
10	300693	盛弘股份	87,000	4,241,250.00	1.16
11	600660	福耀玻璃	70,200	3,540,888.00	0.97
12	601688	华泰证券	167,700	3,457,974.00	0.94

13	688008	澜起科技	7,616	2,360,198.40	0.64
14	601336	新华保险	32,400	1,932,984.00	0.53
15	003816	中国广核	478,700	1,871,717.00	0.51
16	601111	中国国航	304,800	1,844,040.00	0.50
17	600887	伊利股份	67,800	1,624,488.00	0.44
18	002027	分众传媒	304,112	1,471,902.08	0.40
19	688256	寒武纪	818	1,305,159.90	0.36
20	000089	深圳机场	215,500	1,299,465.00	0.35
21	300576	容大感光	24,000	1,229,280.00	0.34
22	688802	沐曦股份	1,332	1,024,161.48	0.28
23	002736	国信证券	69,000	689,310.00	0.19
24	601066	中信建投	22,700	659,889.00	0.18
25	301305	朗坤科技	17,200	490,544.00	0.13
26	002156	通富微电	5,200	394,524.00	0.11
27	002050	三花智控	8,400	368,172.00	0.10
28	688158	优刻得	9,708	356,866.08	0.10
29	301666	大普微	723	334,987.59	0.09
30	300054	鼎龙股份	2,034	215,542.98	0.06
31	688781	视涯科技	4,367	184,112.72	0.05
32	001965	招商公路	18,800	172,208.00	0.05
33	688545	兴福电子	994	132,261.64	0.04
34	688818	电科蓝天	1,478	103,666.92	0.03
35	002142	宁波银行	3,200	95,008.00	0.03
36	002517	恺英网络	5,500	89,375.00	0.02
37	688702	盛科通信	200	77,998.00	0.02
38	688002	睿创微纳	500	77,345.00	0.02
39	688629	华丰科技	400	75,004.00	0.02
40	688797	臻宝科技	160	74,987.20	0.02
41	688521	芯原股份	200	74,228.00	0.02
42	688308	欧科亿	400	72,724.00	0.02
43	301682	宏明电子	452	72,347.12	0.02
44	688090	瑞松科技	650	69,192.50	0.02
45	688396	华润微	700	68,285.00	0.02
46	688378	奥来德	1,100	68,200.00	0.02
47	605060	联德股份	1,200	68,088.00	0.02
48	002859	洁美科技	600	65,706.00	0.02
49	603901	永创智能	5,800	63,046.00	0.02
50	300373	扬杰科技	400	62,892.00	0.02
51	002779	中坚科技	800	62,848.00	0.02
52	688206	概伦电子	1,400	62,118.00	0.02
53	601500	通用股份	17,000	62,050.00	0.02
54	600320	振华重工	14,900	61,537.00	0.02
55	688257	新锐股份	600	61,140.00	0.02

56	601360	三六零	7,000	60,830.00	0.02
57	000792	盐湖股份	2,000	60,380.00	0.02
58	603699	纽威股份	1,200	60,360.00	0.02
59	002250	联化科技	4,400	60,148.00	0.02
60	688059	华锐精密	300	59,913.00	0.02
61	002284	亚太股份	6,300	59,787.00	0.02
62	002747	埃斯顿	1,600	59,728.00	0.02
63	301031	中熔电气	500	59,725.00	0.02
64	300856	科思股份	5,600	59,696.00	0.02
65	605016	百龙创园	2,300	59,455.00	0.02
66	688628	优利德	600	59,364.00	0.02
67	603239	浙江仙通	4,000	59,240.00	0.02
68	300590	移为通信	4,100	58,835.00	0.02
69	603638	艾迪精密	2,500	58,625.00	0.02
70	603187	海容冷链	5,100	58,599.00	0.02
71	002414	高德红外	4,400	58,344.00	0.02
72	300113	顺网科技	3,200	58,272.00	0.02
73	600268	国电南自	5,000	58,100.00	0.02
74	002487	大金重工	1,000	57,970.00	0.02
75	002115	三维通信	5,600	57,680.00	0.02
76	600150	中国船舶	1,700	57,443.00	0.02
77	688328	深科达	600	57,420.00	0.02
78	300681	英搏尔	2,000	57,240.00	0.02
79	600570	恒生电子	2,700	57,213.00	0.02
80	600989	宝丰能源	2,800	56,924.00	0.02
81	300919	中伟新材	1,300	56,875.00	0.02
82	688388	嘉元科技	1,290	56,760.00	0.02
83	002709	天赐材料	1,100	56,573.00	0.02
84	002886	沃特股份	2,000	56,180.00	0.02
85	300398	飞凯材料	900	55,575.00	0.02
86	000408	藏格矿业	800	55,456.00	0.02
87	000949	新乡化纤	8,700	55,158.00	0.02
88	002545	东方铁塔	3,400	55,148.00	0.02
89	601231	环旭电子	1,700	55,080.00	0.02
90	600230	沧州大化	4,200	54,684.00	0.01
91	600522	中天科技	900	54,612.00	0.01
92	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
93	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
94	600869	远东股份	1,600	53,552.00	0.01
95	001339	智微智能	520	53,185.60	0.01
96	688400	凌云光	800	52,960.00	0.01
97	002384	东山精密	200	52,470.00	0.01
98	301349	信德新材	700	51,520.00	0.01

99	002281	光迅科技	200	51,388.00	0.01
100	688227	品高股份	500	51,345.00	0.01
101	603061	金海通	100	50,222.00	0.01
102	300223	北京君正	200	49,780.00	0.01
103	601208	东材科技	700	49,553.00	0.01
104	301217	铜冠铜箔	300	49,521.00	0.01
105	300033	同花顺	200	48,200.00	0.01
106	001389	广合科技	200	47,450.00	0.01
107	688392	骄成超声	200	45,436.00	0.01
108	002008	大族激光	300	45,033.00	0.01
109	301486	致尚科技	200	41,664.00	0.01
110	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
111	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
112	300857	协创数据	100	33,990.00	0.01
113	600845	宝信软件	1,840	30,599.20	0.01
114	300475	香农芯创	100	30,000.00	0.01
115	601689	拓普集团	505	28,492.10	0.01
116	603459	红板科技	317	26,729.44	0.01
117	002594	比亚迪	300	23,910.00	0.01
118	688123	聚辰股份	110	23,386.00	0.01
119	688811	有研新材	834	20,124.42	0.01
120	600548	深高速	2,400	19,512.00	0.01
121	600893	航发动力	500	19,170.00	0.01
122	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.01
123	002028	思源电气	100	17,300.00	0.00
124	600941	中国移动	200	17,226.00	0.00
125	300274	阳光电源	100	15,902.00	0.00
126	301191	菲菱科思	140	15,897.00	0.00
127	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
128	000333	美的集团	200	15,106.00	0.00
129	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
130	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
131	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
132	688981	中芯国际	58	9,211.56	0.00
133	601112	振石股份	445	7,827.55	0.00
134	000858	五粮液	100	7,400.00	0.00
135	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
136	002714	牧原股份	200	6,998.00	0.00
137	600309	万华化学	100	6,841.00	0.00
138	688582	芯动联科	100	6,500.00	0.00
139	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
140	605333	沪光股份	300	5,115.00	0.00
141	600009	上海机场	200	4,620.00	0.00

142	300434	金石亚药	400	4,492.00	0.00
143	603719	良品铺子	500	4,325.00	0.00
144	301116	益客食品	500	4,280.00	0.00
145	600606	绿地控股	3,500	4,235.00	0.00
146	600300	维维股份	1,500	4,230.00	0.00
147	002482	广田集团	3,500	4,130.00	0.00
148	002573	清新环境	1,400	4,116.00	0.00
149	600390	五矿资本	900	4,104.00	0.00
150	600688	上海石化	1,400	4,102.00	0.00
151	601368	绿城水务	1,000	4,090.00	0.00
152	600008	首创环保	1,500	4,080.00	0.00
152	601828	美凯龙	2,000	4,080.00	0.00
153	000589	贵州轮胎	1,000	4,060.00	0.00
154	000419	通程控股	900	4,059.00	0.00
155	600221	海航控股	3,000	4,050.00	0.00
156	600168	武汉控股	1,000	4,040.00	0.00
157	002210	飞马国际	1,900	4,028.00	0.00
158	000001	平安银行	400	4,020.00	0.00
159	002551	尚荣医疗	1,500	4,005.00	0.00
160	002593	日上集团	1,000	3,990.00	0.00
161	603030	全筑股份	2,000	3,980.00	0.00
162	603077	和邦生物	1,700	3,944.00	0.00
163	601968	宝钢包装	1,000	3,920.00	0.00
164	002425	凯撒文化	1,500	3,915.00	0.00
164	002562	兄弟科技	900	3,915.00	0.00
165	600717	天津港	1,000	3,890.00	0.00
166	000989	九芝堂	500	3,885.00	0.00
167	000709	河钢股份	2,000	3,880.00	0.00
168	600433	冠豪高新	1,200	3,852.00	0.00
169	600419	天润乳业	500	3,785.00	0.00
170	300230	永利股份	900	3,780.00	0.00
171	000059	华锦股份	1,000	3,750.00	0.00
171	603797	联泰环保	1,000	3,750.00	0.00
172	300425	中建环能	1,000	3,740.00	0.00
173	600356	恒丰纸业	500	3,705.00	0.00
173	600827	百联股份	500	3,705.00	0.00
174	000848	承德露露	500	3,700.00	0.00
175	000629	钒钛股份	1,100	3,674.00	0.00
176	300098	高新兴	800	3,672.00	0.00
177	600816	建元信托	1,500	3,660.00	0.00
178	002351	漫步者	400	3,636.00	0.00
179	000402	金融街	1,500	3,615.00	0.00
180	002111	威海广泰	400	3,600.00	0.00

180	600361	创新新材	1,000	3,600.00	0.00
181	300359	全通教育	1,000	3,580.00	0.00
182	603518	锦泓集团	500	3,575.00	0.00
183	002154	报喜鸟	1,000	3,560.00	0.00
184	603600	永艺股份	400	3,548.00	0.00
185	000544	中原环保	500	3,485.00	0.00
186	603689	皖天然气	500	3,465.00	0.00
187	000900	现代投资	1,000	3,460.00	0.00
188	300074	华平股份	1,000	3,400.00	0.00
189	600035	楚天高速	1,000	3,370.00	0.00
190	600704	物产中大	700	3,304.00	0.00
191	601200	上海环境	500	3,300.00	0.00
192	600526	菲达环保	800	3,288.00	0.00
193	600425	青松建化	1,000	3,270.00	0.00
193	600790	轻纺城	1,000	3,270.00	0.00
194	001914	招商积余	400	3,264.00	0.00
195	002274	华昌化工	700	3,241.00	0.00
196	300168	万达信息	700	3,213.00	0.00
197	300439	美康生物	400	3,212.00	0.00
198	002120	韵达股份	500	3,180.00	0.00
199	600512	腾达建设	1,700	3,179.00	0.00
200	600037	歌华有线	500	3,135.00	0.00
201	002352	顺丰控股	100	3,126.00	0.00
202	600210	紫江企业	500	3,100.00	0.00
203	300388	节能国祯	500	3,085.00	0.00
204	300933	中辰股份	500	3,040.00	0.00
205	300213	佳讯飞鸿	500	3,030.00	0.00
206	002148	北纬科技	500	2,905.00	0.00
207	600655	豫园股份	700	2,877.00	0.00
208	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
209	000565	渝三峡 A	500	2,840.00	0.00
210	603900	莱绅通灵	500	2,815.00	0.00
211	600595	中孚实业	500	2,810.00	0.00
212	300732	设研院	500	2,785.00	0.00
213	002752	昇兴股份	500	2,760.00	0.00
213	605138	盛泰集团	500	2,760.00	0.00
214	002412	汉森制药	500	2,750.00	0.00
215	000703	恒逸石化	200	2,714.00	0.00
216	600874	创业环保	500	2,680.00	0.00
217	000553	安道麦 A	500	2,675.00	0.00
217	000605	渤海股份	500	2,675.00	0.00
218	605577	龙版传媒	300	2,643.00	0.00
219	603018	华设集团	500	2,570.00	0.00

220	600731	湖南海利	500	2,560.00	0.00
221	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
222	002266	浙富控股	500	2,530.00	0.00
223	300187	永清环保	500	2,525.00	0.00
224	000906	浙商中拓	500	2,520.00	0.00
224	002563	森马服饰	500	2,520.00	0.00
225	000421	南京公用	500	2,480.00	0.00
226	300575	中旗股份	500	2,460.00	0.00
227	002391	长青股份	500	2,435.00	0.00
228	002640	跨境通	800	2,408.00	0.00
229	000404	长虹华意	300	2,358.00	0.00
230	600616	金枫酒业	600	2,250.00	0.00
231	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
232	600386	北巴传媒	700	2,184.00	0.00
233	000897	津滨发展	1,300	2,158.00	0.00
234	601728	中国电信	400	2,076.00	0.00
235	002381	双箭股份	400	2,072.00	0.00
236	000768	中航西飞	100	2,048.00	0.00
237	600558	大西洋	400	1,976.00	0.00
238	601108	财通证券	200	1,730.00	0.00
239	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
240	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
241	002588	史丹利	200	1,580.00	0.00
242	301656	联合动力	91	1,567.93	0.00
243	002746	仙坛股份	300	1,530.00	0.00
244	600115	中国东航	400	1,524.00	0.00
245	600110	诺德股份	100	1,509.00	0.00
246	300110	华仁药业	600	1,488.00	0.00
247	300094	国联水产	600	1,470.00	0.00
248	002946	新乳业	100	1,408.00	0.00
249	601319	中国人保	200	1,352.00	0.00
250	002061	浙江交科	400	1,320.00	0.00
251	603111	康尼机电	200	1,132.00	0.00
252	000783	长江证券	100	975.00	0.00
253	002739	儒意电影	100	960.00	0.00
254	000812	陕西金叶	300	930.00	0.00
254	600496	精工钢构	300	930.00	0.00
255	601816	京沪高铁	200	906.00	0.00
256	600833	第一医药	100	902.00	0.00
257	600028	中国石化	200	892.00	0.00
258	603818	曲美家居	300	891.00	0.00
259	600251	冠农股份	100	864.00	0.00
260	600050	中国联通	200	800.00	0.00

261	002259	升达林业	200	758.00	0.00
262	002344	海宁皮城	200	700.00	0.00
263	300030	阳普医疗	100	581.00	0.00
264	300381	溢多利	100	562.00	0.00
265	601333	广深铁路	200	550.00	0.00
266	601801	皖新传媒	100	493.00	0.00
267	600229	城市传媒	100	464.00	0.00
268	600048	保利发展	100	463.00	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	300750	宁德时代	19,693,274.00	3.97
2	300274	阳光电源	14,249,857.00	2.87
3	001965	招商公路	14,141,415.00	2.85
4	601318	中国平安	11,692,316.00	2.36
5	688008	澜起科技	11,427,612.11	2.30
6	300054	鼎龙股份	11,420,673.66	2.30
7	600938	中国海油	8,446,098.00	1.70
8	301656	联合动力	8,122,259.00	1.64
9	002558	巨人网络	8,045,066.00	1.62
10	003816	中国广核	7,788,003.00	1.57
11	601021	春秋航空	7,696,261.00	1.55
12	300693	盛弘股份	7,531,422.00	1.52
13	002847	盐津铺子	7,458,140.00	1.50
14	605499	东鹏饮料	7,347,440.40	1.48
15	000429	粤高速 A	7,265,153.00	1.46
16	301606	绿联科技	6,825,762.00	1.38
17	601059	信达证券	4,767,268.00	0.96
18	002142	宁波银行	4,762,053.20	0.96
19	000333	美的集团	4,758,134.00	0.96
20	600398	海澜之家	4,344,477.00	0.88

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	688008	澜起科技	16,768,651.36	3.38
2	300054	鼎龙股份	15,370,767.00	3.10
3	001965	招商公路	14,395,837.00	2.90
4	300274	阳光电源	13,108,714.00	2.64
5	300750	宁德时代	11,432,834.00	2.31
6	688220	翱捷科技	9,203,183.45	1.86
7	002027	分众传媒	8,206,492.00	1.65
8	002558	巨人网络	8,153,431.00	1.64
9	688249	晶合集成	7,304,287.65	1.47
10	000429	粤高速 A	7,156,643.00	1.44
11	688018	乐鑫科技	6,615,365.61	1.33
12	301656	联合动力	6,446,218.91	1.30
13	002847	盐津铺子	6,357,530.92	1.28
14	003816	中国广核	6,234,059.00	1.26
15	301486	致尚科技	5,330,892.65	1.07
16	601318	中国平安	5,174,245.00	1.04
17	601059	信达证券	5,125,383.00	1.03
18	600938	中国海油	5,013,207.00	1.01
19	000333	美的集团	4,827,100.00	0.97
20	300693	盛弘股份	4,649,441.00	0.94

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	320,086,622.38
卖出股票的收入（成交）总额	340,222,210.88

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	20,129,638.36	5.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,087,876.71	2.75
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	20,161,186.30	5.50
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,253,472.88	2.80
7	可转债（可交换债）	629.20	0.00
8	同业存单	39,448,213.70	10.76
9	其他	-	-
10	合计	100,081,017.15	27.30

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	112605153	26 建设银行 CD153	400,000	39,448,213.70	10.76
2	019827	26 国债 01	200,000	20,129,638.36	5.49
3	102581323	25 华宝投资 MTN001A	100,000	10,253,472.88	2.80
4	524250	25 昆仑 03	100,000	10,089,317.81	2.75
5	212480013	24 交行债 01	100,000	10,087,876.71	2.75

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资于本基金管理人管理的权益类证券投资基金及全市场的股票型交易型开放式指数证券投资基金。本基金投资的权益类证券投资基金包括股票型基金以及至少满足以下一条标准的混合型基金：（1）基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于 60%；（2）基金最近 4 期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于 60%。根据对当前宏观经济形势的判断，自上而下的选择相对价值较高的基金品种进行投资。基金选择上以长期可持续的超额收益能力作为核心目标，采用定量分析和定性分析相结合的方式，一方面通过量化规则筛选出投资价值相对突出的标的，另一方面通过定性的方式对基金进行二次研判，多维度共同筛选出匹配组合投资策略，适合组合参与的投资标的。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例(%)	是否属于基金 管理人及管理 人关联方所管 理的基金
1	588200	嘉实上证 科创板芯 片 ETF	交易型开 放式	10,000.00	49,360.00	0.01%	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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，中国建设银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行、国家外汇管理局山西省分局、国家金融监督管理总局上海监管局、深圳市市场监督管理局(深圳市知识产权局)、韶山市城市管理和综合执法局的处罚，在报告编制前一年受到中国人民银行南通市分行、中国人民银行娄底市分行的通报批评。交通银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行、国家外汇管理局湖北省分局、国家金融监督管理总局上海监管局、金融监管总局的处罚，在报告编制前一年受到中国人民银行威海市分行、中国人民银行山东省分行的通报批评。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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	263,744.14
2	应收清算款	51,098,707.33
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,349.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,363,800.89

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净值 比例(%)	流通受限情况说 明
1	300750	宁德时代	7,314,132.00	1.99	非公开发行限售

7.13.6 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
博时稳合一年持有期混合 A	1,054	98,051.98	729,663.29	0.71%	102,617,121.71	99.29%
博时稳合一年持有期混合 C	1,704	137,350.21	134,060.24	0.06%	233,910,702.95	99.94%
合计	2,703	124,821.14	863,723.53	0.26%	336,527,824.66	99.74%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	96.99%

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

其中，投资者指指标计算期间持有过基金份额的投资者，盈利投资者指投资者区间净收益不小于零的投资者。

投资者区间净收益=投资者区间收益-基金交易手续费（认申购费、赎回费、转换费等）。其中，区间收益=持有期末市值-持有期初市值+（赎回+转出+非交易过户出）-（认购+申购+定投+转入+非交易过户入）+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易，剔除场内相关数据（如有）。

8.3 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	博时稳合一年持有期混合 A	199.82	0.00%
	博时稳合一年持有期混合 C	-	-

	合计	199.82	0.00%
--	----	--------	-------

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时稳合一年持有期混合 A	博时稳合一年持有期混合 C
基金合同生效日（2024 年 4 月 17 日）基金份额总额	164,230,264.28	444,404,236.20
本报告期初基金份额总额	136,853,592.88	316,483,367.98
本报告期基金总申购份额	8,485,213.06	12,548,264.93
减：本报告期基金总赎回份额	41,992,020.94	94,986,869.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	103,346,785.00	234,044,763.19

§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。

2026 年 2 月 28 日，本基金托管人广发银行股份有限公司工作安排，安琦瑜先生不再担任资产托管部总经理助理。

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会等重大影响事件。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 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。

10.7.2 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。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员未受到调查或处罚等情况。

10.8 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

10.8.1 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

券商名称	交易 单元	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总 额的比例		金总量的 比例	
国泰海通	4	649,745,585.32	100.00%	303,679.18	100.00%	增加 1 个

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。

10.8.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期 基金成 交总额 的比例
国泰海通	171,579,334.87	100.00%	5,821,011,000.00	100.00%	-	-	313,499.70	100.00%

10.9 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	博时稳合一年持有期混合型证券投资基金（博时稳合一年持有期混合 C）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-26
2	博时稳合一年持有期混合型证券投资基金（博时稳合一年持有期混合 A）基金产品资料概要	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-26

	更新	露网站	
3	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-05-29
4	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-30
5	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-28
6	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-24
7	博时稳合一年持有期混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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）	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31
9	博时稳合一年持有期混合型证券投资基金 2025 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31
10	博时稳合一年持有期混合型证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-06
11	博时稳合一年持有期混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-05
12	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-26
13	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-14
14	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-24
15	博时稳合一年持有期混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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

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稳合一年持有期混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时稳合一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时稳合一年持有期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、博时稳合一年持有期混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时稳合一年持有期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

二〇二六年八月三十一日