

博时创业板综合交易型开放式指数证券投资 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	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	3
§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	4
§4 管理人报告	4
4.1 基金管理人及基金经理情况	5
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	7
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	7
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	8
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	8
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	9
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	9
§5 托管人报告	9
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	9
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	9
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	9
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	9
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	11
6.3 净资产变动表	13
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	35
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	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	52
§8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§9 开放式基金份额变动	53

§10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
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	55
10.8 其他重大事件	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时创业板综合 ETF
场内简称	创业板综 ETF 博时
基金主代码	159287
交易代码	159287
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 8 月 15 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	93,568,753.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2025 年 8 月 27 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金通过综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本、交易限制等因素，可以选择采取完全复制法或抽样复制法构建基金的股票投资组合，以更好地实现跟踪标的指数的目的。如果标的指数成份股发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。在正常情况下，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 0.2%，预期年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金日均跟踪偏离度和跟踪误差变大，基金管理人应采取合理措施，避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及

	增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。本基金的投资策略还包括债券（除可转换债券、可交换债券）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、金融衍生品投资策略、融资和转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即创业板综合指数收益率。
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。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪创业板综合指数，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	郭明
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区复兴门内大街55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	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		张东	廖林

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	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	38,164,343.48
本期利润	50,824,615.20
加权平均基金份额本期利润	0.2376
本期加权平均净值利润率	20.35%
本期基金份额净值增长率	22.88%
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	31,098,737.60
期末可供分配基金份额利润	0.3324
期末基金资产净值	124,667,490.60
期末基金份额净值	1.3324
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	33.24%

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	23.61%	1.95%	24.75%	1.95%	-1.14%	0.00%
过去六个月	22.88%	1.78%	24.15%	1.79%	-1.27%	-0.01%
自基金合同生效起至今	33.24%	1.67%	43.87%	1.70%	-10.63%	-0.03%

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



注：本基金的基金合同于 2025 年 8 月 15 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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		
万琼	指数与量化投资部投资总监助理/基金经理	2025-08-15	-	19.3	万琼女士，硕士。2004 年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011 年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2017 年 9 月 29 日-2019 年 9 月 5 日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 30 日-2022 年 5 月 27 日)、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、博时中证可持续发展 100 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 1 月 19 日-2023 年 3 月 8 日)、博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 3 月 20 日-2023 年 3 月 8 日)、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月

					3 日-2023 年 3 月 8 日)、博时创业板指数证券投资基金(2021 年 4 月 2 日-2023 年 3 月 8 日)、博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) (2022 年 7 月 26 日-2023 年 9 月 25 日)、博时中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2022 年 3 月 3 日-2024 年 11 月 8 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资总监助理兼博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 8 月 1 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (2019 年 12 月 30 日—至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 3 月 18 日—至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金 (2021 年 5 月 11 日—至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 5 月 17 日—至今)、博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)(2021 年 6 月 8 日—至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) (2021 年 12 月 21 日—至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)(2021 年 12 月 28 日—至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2022 年 1 月 10 日—至今)、博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) (2023 年 4 月 19 日—至今)、博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) (2023 年 9 月 26 日—至今)、博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金(2025
--	--	--	--	--	--

					年 8 月 15 日—至今)、博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2025 年 12 月 2 日—至今)、博时恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金(2026 年 5 月 20 日—至今)的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 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，中国经济延续供给强、需求弱的弱复苏格局，且内部结构持续分化。生产端在 AI 算力、高技术制造与出口高景气带动下动能较为强劲并逐月加速，需求端则内需较为低迷、地产链持续拖累，仅靠外需支撑。经济含新量继续提升，且产业升级红利正从生产端向利润端传导。价格链是上半年最大的边际变化—PPI 同比在中东冲突推升大宗商品价格的传导下，由负快速转正并走高，名义修复加速兑现。

海外方面，全球资产围绕地缘冲突、AI 浪潮与政策分化重新定价。2 季度前期，霍尔木兹海峡通行量持续低位，国际油价冲高，随着美伊局势边际缓和，原油高位震荡回落，外部流动性压力阶段性释放。政

策上，美联储在通胀韧性与油价扰动下转向谨慎，全球流动性阶段性收紧。同时，海外 AI 产业趋势延续高景气，与国内 AI 产业链形成共振。

资本市场上，A 股市场成交活跃，结构持续分化。1 季度末在美伊冲突催化下，避险情绪升温，红利与顺周期占优，前期热门科技成长板块承压，市场震荡回调；进入 4 月后，随着外部扰动减退、油价回落及 1 季报收官，全 A 盈利增速回暖，市场核心逻辑由估值修复切换至业绩兑现，转入景气驱动的结构性价行情，呈现“科技领涨、指数震荡抬升”格局，AI 算力等高景气赛道获资金集中增配。

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 1.3324 元，份额累计净值为 1.3324 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 22.88%，同期业绩基准增长率 24.15%。

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 2026 年下半年，总量盈利周期延续修复趋势，但预计结构分化仍将持续。下半年全 A 盈利仍受 PPI 正向支撑，但对盈利总量的解释力将弱于上半年。预计下半年部分资源品、以及有供需缺口的 TMT 等继续受益 PPI 周期；而消费、内需链、传统中下游制造，仍面临利润挤压压力。A 股市场下半年出现系统性价值风格切换的难度较大，科技仍将是主要方向，但投资逻辑将从题材驱动转向业绩筛选，市场风格可能趋于均衡。

在投资策略上，本基金作为一只被动策略的指数基金，会以最小化跟踪误差为目标，紧密跟踪标的指数。

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

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人——博时基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：博时创业板综合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	1,296,622.68	1,034,791.32
结算备付金		286,240.26	1,213,104.77
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.6.2	123,124,663.81	329,247,653.50
其中：股票投资		123,124,663.81	329,247,653.50
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	1,915.30
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	60,492.63	-
资产总计		124,768,019.38	331,497,464.89

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		-	114,162.40
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		15,806.46	18,893.81
应付托管费		5,268.84	6,297.95
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	79,453.48	38,000.00
负债合计		100,528.78	177,354.16
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	93,568,753.00	305,568,753.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	31,098,737.60	25,751,357.73
净资产合计		124,667,490.60	331,320,110.73
负债和净资产总计		124,768,019.38	331,497,464.89

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3324 元，基金份额总额 93,568,753.00 份。

6.2 利润表

会计主体：博时创业板综合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
一、营业总收入		51,212,476.23
1.利息收入		2,287.61
其中：存款利息收入	6.4.6.9	2,287.61
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）		38,518,418.64
其中：股票投资收益	6.4.6.10	37,619,596.57
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.6.11	-
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	-
股利收益	6.4.6.14	898,822.07
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	12,660,271.72
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	31,498.26
减：二、营业总支出		387,861.03
1. 管理人报酬		187,393.02

其中：暂估管理人报酬（若有）		-
2. 托管费		62,464.36
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		-
8. 其他费用	6.4.6.18	138,003.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		50,824,615.20
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		50,824,615.20
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		50,824,615.20

6.3 净资产变动表

会计主体：博时创业板综合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	305,568,753.00	-	25,751,357.73	331,320,110.73
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	305,568,753.00	-	25,751,357.73	331,320,110.73
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-212,000,000.00	-	5,347,379.87	-206,652,620.13
(一)、综合收益总额	-	-	50,824,615.20	50,824,615.20
(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)	-212,000,000.00	-	-45,477,235.33	-257,477,235.33
其中：1.基金申购款	96,000,000.00	-	14,043,536.28	110,043,536.28
2.基金赎回款	-308,000,000.00	-	-59,520,771.61	-367,520,771.61
(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	93,568,753.00	-	31,098,737.60	124,667,490.60

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

博时创业板综合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[2025]1583 号《关于准予博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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《博时创业板综合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，

本基金于 2025 年 8 月 4 日起至 2025 年 8 月 12 日止期间募集不包括认购资金利息共募集人民币 421,546,000.00 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2025）验字第 70019484_A20 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 8 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 421,568,753.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 22,753.00 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所（“深交所”）深证上[2025]896 号核准，本基金于 2025 年 8 月 27 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时创业板综合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)。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于依法发行上市的非成份股（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票和存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、国债期货、股指期货、股票期权、货币市场工具（包括银行存款、同业存单等）、债券回购、资产支持证券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）。本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。未来在法律法规允许的前提下，本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。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。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；本基金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。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。本基金的业绩比较基准为：创业板综合指数收益率。

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》、《博时创业板综合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 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	1,296,622.68
等于：本金	1,296,505.41
加：应计利息	117.27
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	1,296,622.68

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		104,715,782.94	-	123,124,663.81	18,408,880.87
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		104,715,782.94	-	123,124,663.81	18,408,880.87

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

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	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款	1,102.20
预提费用	78,351.28
合计	79,453.48

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	305,568,753.00	305,568,753.00
本期申购	96,000,000.00	96,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-308,000,000.00	-308,000,000.00
本期末	93,568,753.00	93,568,753.00

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	32,633,065.37	-6,881,707.64	25,751,357.73
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	32,633,065.37	-6,881,707.64	25,751,357.73
本期利润	38,164,343.48	12,660,271.72	50,824,615.20
本期基金份额交易产生的变动数	-39,135,672.11	-6,341,563.22	-45,477,235.33
其中：基金申购款	11,906,567.86	2,136,968.42	14,043,536.28
基金赎回款	-51,042,239.97	-8,478,531.64	-59,520,771.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,661,736.74	-562,999.14	31,098,737.60

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	2,051.17
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	236.44
其他	-
合计	2,287.61

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	6,445,418.92
股票投资收益——赎回差价收入	31,174,177.65
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	37,619,596.57

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	85,496,861.55
减：卖出股票成本总额	78,965,731.97
减：交易费用	85,710.66
买卖股票差价收入	6,445,418.92

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	367,520,771.61
减：现金支付赎回款总额	168,734.61
减：赎回股票成本总额	336,177,859.35
减：交易费用	-
赎回差价收入	31,174,177.65

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

无发生额。

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

无发生额。

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	898,822.07
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	898,822.07
----	------------

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	12,660,271.72
——股票投资	12,660,271.72
——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	-
——权证投资	-
3.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	12,660,271.72

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	31,498.26
合计	31,498.26

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	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	145.00
中登注册登记费	59,507.37
合计	138,003.65

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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
博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“博时创业板综合 ETF 联接”）	基金管理人管理的其他基金

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
当期发生的基金应支付的管理费	187,393.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,970.46
应支付基金管理人的净管理费	181,422.56

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 0.15% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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托管费	62,464.36

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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 × 0.05% / 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
博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金	71,950,227.00	76.90%	265,939,927.00	87.03%
招商证券	2,377,669.00	2.54%	2,635,617.00	0.86%

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

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	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	1,296,622.68	2,051.17

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	320.00	5,187.20
招商证券股份有限公司	001365	天海电子	网下发行	664.00	18,054.16

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：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
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	首次公开发行限售	46.08	463.33	418.00	19,261.44	193,671.94	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	首次公开发行限售	10.12	27.73	662.00	6,699.44	18,357.26	-
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	首次公开发行限售	13.30	51.56	256.00	3,404.80	13,199.36	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	首次公开发行限售	13.91	32.47	333.00	4,632.03	10,812.51	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	首次公开发行限售	7.08	28.40	303.00	2,145.24	8,605.20	-
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	-

001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	首次公开发行限售	27.19	31.31	200.00	5,438.00	6,262.00	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	首次公开发行限售	30.38	38.99	147.00	4,465.86	5,731.53	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	首次公开发行限售	53.26	58.74	81.00	4,314.06	4,757.94	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	首次公开发行限售	18.38	16.78	96.00	1,764.48	1,610.88	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单 价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300332	天壕能源	2026-06-26	重大事项停牌	4.30	2026-07-09	4.64	24,300.00	147,689.77	104,490.00	-

注：本基金截至 2026 年 6 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的证券，该类证券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪创业板综合指数，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紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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

无。

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约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%。

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	1,296,622.68	-	-	-	1,296,622.68
结算备付金	286,240.26	-	-	-	286,240.26
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	123,124,663.81	123,124,663.81
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	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	1,582,862.94	-	-	123,185,156.44	124,768,019.38
负债					
卖出回购金融资 产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	15,806.46	15,806.46
应付托管费	-	-	-	5,268.84	5,268.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	79,453.48	79,453.48
负债总计	-	-	-	100,528.78	100,528.78
利率敏感度缺 口	1,582,862.94	-	-	123,084,627.66	124,667,490.60
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	1,034,791.32	-	-	-	1,034,791.32
结算备付金	1,213,104.77	-	-	-	1,213,104.77
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	329,247,653.50	329,247,653.50
应收清算款	-	-	-	1,915.30	1,915.30
买入返售金融资 产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,247,896.09	-	-	329,249,568.80	331,497,464.89

负债					
卖出回购金融资 产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	114,162.40	114,162.40
应付管理人报酬	-	-	-	18,893.81	18,893.81
应付托管费	-	-	-	6,297.95	6,297.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	38,000.00	38,000.00
负债总计	-	-	-	177,354.16	177,354.16
利率敏感度缺 口	2,247,896.09	-	-	329,072,214.64	331,320,110.73

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约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	123,124,663.81	98.76	329,247,653.50	99.37
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	123,124,663.81	98.76	329,247,653.50	99.37

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 659	增加约 1,694
	业绩比较基准下降 5%	减少约 659	减少约 1,694

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	122,750,132.71
第二层次	104,490.00
第三层次	270,041.10
合计	123,124,663.81

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	123,124,663.81	98.68
	其中：股票	123,124,663.81	98.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,582,862.94	1.27
8	其他各项资产	60,492.63	0.05
9	合计	124,768,019.38	100.00

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	641,689.00	0.51
B	采矿业	279,902.00	0.22
C	制造业	101,788,396.20	81.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	402,893.00	0.32
E	建筑业	196,930.00	0.16
F	批发和零售业	2,708,671.00	2.17
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	9,146,372.20	7.34
J	金融业	2,848,001.00	2.28
K	房地产业	99,958.00	0.08
L	租赁和商务服务业	709,230.60	0.57
M	科学研究和技术服务业	2,034,327.20	1.63
N	水利、环境和公共设施管理业	540,723.00	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	93,035.00	0.07
Q	卫生和社会工作	623,272.00	0.50
R	文化、体育和娱乐业	974,544.00	0.78
S	综合	-	-
	合计	123,087,944.20	98.73

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	36,719.61	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	36,719.61	0.03

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	300750	宁德时代	30,300	11,908,203.00	9.55
2	300308	中际旭创	8,300	10,541,000.00	8.46
3	300502	新易盛	10,260	6,227,820.00	5.00
4	300394	天孚通信	9,140	2,766,495.20	2.22
5	300476	胜宏科技	7,600	2,632,868.00	2.11
6	300408	三环集团	13,600	2,269,840.00	1.82
7	300274	阳光电源	13,000	2,067,260.00	1.66
8	300433	蓝思科技	38,400	2,060,544.00	1.65
9	300059	东方财富	86,300	1,758,794.00	1.41
10	301308	江波龙	2,300	1,618,740.00	1.30
11	300124	汇川技术	18,200	1,207,206.00	0.97
12	300604	长川科技	3,500	1,194,970.00	0.96
13	300857	协创数据	3,440	1,169,256.00	0.94
14	301200	大族数控	3,100	1,118,015.00	0.90
15	300760	迈瑞医疗	7,900	1,073,057.00	0.86
16	300014	亿纬锂能	15,000	975,450.00	0.78

17	300475	香农芯创	3,200	960,000.00	0.77
18	301217	铜冠铜箔	5,800	957,406.00	0.77
19	300442	润泽科技	11,100	922,077.00	0.74
20	300223	北京君正	3,000	746,700.00	0.60
21	300033	同花顺	2,960	713,360.00	0.57
22	300136	信维通信	5,800	691,650.00	0.55
23	300757	罗博特科	1,100	680,900.00	0.55
24	300285	国瓷材料	6,200	639,716.00	0.51
25	301165	锐捷网络	7,880	633,946.00	0.51
26	300620	光库科技	1,600	605,120.00	0.49
27	300661	圣邦股份	4,100	588,268.00	0.47
28	300054	鼎龙股份	5,300	561,641.00	0.45
29	300373	扬杰科技	3,500	550,305.00	0.44
30	300316	晶盛机电	8,600	519,440.00	0.42
31	300666	江丰电子	1,400	516,040.00	0.41
32	300548	长芯博创	1,800	500,400.00	0.40
33	300498	温氏股份	39,200	482,944.00	0.39
34	300567	精测电子	1,500	476,400.00	0.38
35	301526	国际复材	10,100	471,367.00	0.38
36	300395	菲利华	3,500	468,055.00	0.38
37	300390	天华新能	5,000	467,550.00	0.38
38	300346	南大光电	4,800	444,720.00	0.36
39	300450	先导智能	10,500	427,560.00	0.34
40	300015	爱尔眼科	51,600	426,216.00	0.34
41	301269	华大九天	3,500	417,970.00	0.34
42	300672	国科微	1,400	413,000.00	0.33
43	301358	湖南裕能	5,400	409,698.00	0.33
44	301511	德福科技	2,700	388,395.00	0.31
45	301396	宏景科技	1,160	384,656.00	0.31
46	300870	欧陆通	1,100	380,259.00	0.31
47	300803	指南针	4,100	375,847.00	0.30
48	300782	卓胜微	3,300	361,614.00	0.29
49	300037	新宙邦	3,800	352,830.00	0.28
50	300751	迈为股份	1,200	338,952.00	0.27
51	300058	蓝色光标	24,200	332,992.00	0.27
52	301377	鼎泰高科	600	330,540.00	0.27
53	300418	昆仑万维	8,100	326,916.00	0.26
54	300319	麦捷科技	10,400	308,152.00	0.25
55	300398	飞凯材料	4,900	302,575.00	0.24
56	300570	太辰光	1,200	296,052.00	0.24
57	300759	康龙化成	10,200	295,086.00	0.24
58	300001	特锐德	7,600	287,508.00	0.23
59	300765	石药创新	10,400	283,192.00	0.23
60	300088	长信科技	24,300	281,880.00	0.23

61	300236	上海新阳	2,100	276,150.00	0.22
62	300115	长盈精密	9,800	273,812.00	0.22
63	300919	中伟新材	6,200	271,250.00	0.22
64	300806	斯迪克	2,400	268,800.00	0.22
65	301205	联特科技	800	267,280.00	0.21
66	300814	中富电路	1,300	265,850.00	0.21
67	300975	商络电子	5,100	263,925.00	0.21
68	300024	机器人	13,500	260,955.00	0.21
69	300623	捷捷微电	5,800	260,942.00	0.21
70	300438	鹏辉能源	3,100	256,835.00	0.21
71	300903	科翔股份	2,500	253,275.00	0.20
72	300979	华利集团	8,500	252,875.00	0.20
73	300748	金力永磁	8,100	249,885.00	0.20
74	301236	软通动力	5,800	246,210.00	0.20
75	300432	富临精工	12,200	245,098.00	0.20
76	300811	铂科新材	2,540	241,020.60	0.19
77	300832	新产业	5,700	239,400.00	0.19
78	300207	欣旺达	12,500	237,375.00	0.19
79	300558	贝达药业	3,600	234,252.00	0.19
80	300747	锐科激光	4,300	228,287.00	0.18
81	300458	全志科技	5,760	227,289.60	0.18
82	301018	申菱环境	1,940	224,283.40	0.18
83	300339	润和软件	5,800	223,358.00	0.18
84	300017	网宿科技	17,100	222,471.00	0.18
85	300260	新莱应材	2,200	221,012.00	0.18
86	300866	安克创新	2,100	219,450.00	0.18
87	300762	上海瀚讯	4,800	219,120.00	0.18
88	300251	光线传媒	19,700	218,473.00	0.18
89	300763	锦浪科技	2,400	216,840.00	0.17
90	300821	东岳硅材	10,400	213,824.00	0.17
91	300474	景嘉微	3,500	211,680.00	0.17
92	300972	万辰集团	1,200	208,092.00	0.17
93	300323	华灿光电	10,200	208,080.00	0.17
94	300655	晶瑞电材	9,700	207,774.00	0.17
95	300347	泰格医药	4,300	206,400.00	0.17
96	302132	中航成飞	3,500	204,120.00	0.16
97	301072	中捷精工	4,900	200,949.00	0.16
98	300257	开山股份	7,000	200,760.00	0.16
99	301319	唯特偶	1,195	199,959.35	0.16
100	301389	隆扬电子	2,300	199,617.00	0.16
101	300679	电连技术	3,300	197,967.00	0.16
102	300179	四方达	3,300	196,119.00	0.16
103	300568	星源材质	10,400	194,688.00	0.16
104	301666	大普微	418	193,671.94	0.16

105	300454	深信服	2,000	192,400.00	0.15
106	300184	力源信息	10,900	191,295.00	0.15
107	300142	沃森生物	14,600	189,654.00	0.15
108	300083	创世纪	13,800	187,956.00	0.15
109	300201	海伦哲	8,900	187,523.00	0.15
110	300843	胜蓝股份	1,200	187,500.00	0.15
111	301188	力诺药包	2,800	187,320.00	0.15
112	300456	赛微电子	4,400	186,868.00	0.15
113	300671	富满微	2,165	186,536.40	0.15
114	300953	震裕科技	1,380	184,506.00	0.15
115	300005	探路者	8,100	183,060.00	0.15
116	300263	隆华科技	11,200	182,560.00	0.15
117	300102	乾照光电	7,000	182,280.00	0.15
118	300602	飞荣达	3,500	179,200.00	0.14
119	301238	瑞泰新材	7,300	178,120.00	0.14
120	301297	富乐德	2,900	177,596.00	0.14
121	300503	昊志机电	1,900	175,370.00	0.14
122	300304	云意电气	9,800	174,930.00	0.14
123	300699	光威复材	6,100	174,765.00	0.14
124	300894	火星人	13,900	174,584.00	0.14
125	300144	宋城演艺	30,000	174,300.00	0.14
126	300596	利安隆	3,300	173,184.00	0.14
127	300496	中科创达	2,800	173,012.00	0.14
128	300073	当升科技	3,600	172,944.00	0.14
129	300383	光环新网	13,900	172,916.00	0.14
130	300735	光弘科技	7,500	170,550.00	0.14
131	300863	卡倍亿	2,220	170,118.60	0.14
132	300334	津膜科技	16,200	168,804.00	0.14
133	300613	富瀚微	2,100	168,168.00	0.13
134	300209	行云科技	5,800	167,910.00	0.13
135	300085	银之杰	4,800	167,856.00	0.13
136	300657	弘信电子	3,800	167,276.00	0.13
137	300077	国民技术	5,300	166,155.00	0.13
138	301127	武汉天源	8,000	165,760.00	0.13
139	300342	天银机电	3,500	164,500.00	0.13
140	301093	华兰股份	1,200	162,756.00	0.13
141	300003	乐普医疗	13,700	162,345.00	0.13
142	300888	稳健医疗	5,800	162,342.00	0.13
143	301035	润丰股份	3,470	161,008.00	0.13
144	300131	英唐智控	8,400	159,852.00	0.13
145	300382	斯莱克	6,900	159,459.00	0.13
146	300576	容大感光	3,100	158,782.00	0.13
147	301021	英诺激光	1,300	158,470.00	0.13
148	300738	奥飞数据	7,800	157,716.00	0.13

149	301123	奕东电子	1,300	156,936.00	0.13
150	300255	常山药业	6,700	156,914.00	0.13
151	300294	博雅生物	11,000	156,640.00	0.13
152	301150	中一科技	2,460	155,250.60	0.12
153	301536	星宸科技	1,200	154,452.00	0.12
154	301005	超捷股份	1,380	153,952.80	0.12
155	300327	中颖电子	4,800	153,840.00	0.12
156	300302	同有科技	3,000	153,510.00	0.12
157	300726	宏达电子	1,800	152,226.00	0.12
158	300628	亿联网络	4,500	152,190.00	0.12
159	300676	华大基因	4,300	150,758.00	0.12
160	300627	华测导航	5,300	150,520.00	0.12
161	300197	节能铁汉	78,000	148,980.00	0.12
162	300416	苏试试验	7,300	148,774.00	0.12
163	300724	捷佳伟创	2,100	148,260.00	0.12
164	300896	爱美客	1,700	148,240.00	0.12
165	300957	贝泰妮	4,700	148,097.00	0.12
166	301071	力量钻石	1,600	148,000.00	0.12
167	300482	万孚生物	8,900	147,829.00	0.12
168	300357	我武生物	6,300	146,916.00	0.12
169	300303	聚飞光电	13,100	144,886.00	0.12
170	300607	拓斯达	3,500	144,305.00	0.12
171	300720	海川智能	1,500	144,300.00	0.12
172	300012	华测检测	10,400	144,144.00	0.12
173	300122	智飞生物	12,300	143,787.00	0.12
174	301095	广立微	1,200	141,660.00	0.11
175	300487	蓝晓科技	2,400	141,240.00	0.11
176	300252	金信诺	8,100	139,725.00	0.11
177	300773	拉卡拉	9,060	138,618.00	0.11
178	300166	东方国信	7,800	138,138.00	0.11
179	300193	佳士科技	16,900	137,566.00	0.11
180	300034	钢研高纳	8,000	137,120.00	0.11
181	300677	英科医疗	3,500	137,095.00	0.11
182	300199	翰宇药业	6,200	136,896.00	0.11
183	300364	中文在线	5,800	136,822.00	0.11
184	300938	信测标准	2,740	136,671.20	0.11
185	300331	苏大维格	1,900	135,109.00	0.11
186	301177	迪阿股份	4,900	135,093.00	0.11
187	300002	神州泰岳	17,200	134,332.00	0.11
188	301550	斯菱智驱	1,462	133,670.66	0.11
189	301151	冠龙节能	8,100	133,650.00	0.11
190	300168	万达信息	29,100	133,569.00	0.11
191	300100	双林股份	4,800	133,344.00	0.11
192	300145	南方泵业	24,400	132,980.00	0.11

193	300761	立华股份	8,100	132,921.00	0.11
194	300435	中泰股份	4,900	132,643.00	0.11
195	301520	万邦医药	4,080	132,600.00	0.11
196	300224	正海磁材	9,900	131,967.00	0.11
197	300660	江苏雷利	4,730	131,777.80	0.11
198	301090	华润材料	20,900	131,043.00	0.11
199	300723	一品红	3,500	130,480.00	0.10
200	301275	汉朔科技	2,900	130,210.00	0.10
201	300741	华宝股份	10,400	130,208.00	0.10
202	300222	科大智能	9,400	130,190.00	0.10
203	300691	联合光电	8,100	128,061.00	0.10
204	300400	劲拓股份	3,400	128,010.00	0.10
205	300261	雅本化学	28,500	127,395.00	0.10
206	300790	宇瞳光学	4,860	126,894.60	0.10
207	301116	益客食品	14,800	126,688.00	0.10
208	300769	德方纳米	1,900	126,350.00	0.10
209	300315	掌趣科技	32,200	125,580.00	0.10
210	301207	华兰疫苗	7,700	125,433.00	0.10
211	300618	寒锐钴业	3,500	124,950.00	0.10
212	300455	航天智装	5,800	124,932.00	0.10
213	300852	四会富仕	1,800	124,632.00	0.10
214	301029	怡合达	4,600	124,246.00	0.10
215	301087	可孚医疗	2,600	123,890.00	0.10
216	300480	光力科技	2,900	123,772.00	0.10
217	300440	运达科技	5,800	123,714.00	0.10
218	300185	通裕重工	45,300	123,669.00	0.10
219	300717	华信新材	5,800	123,540.00	0.10
220	300229	拓尔思	8,900	122,998.00	0.10
221	300739	明阳电路	3,500	122,990.00	0.10
222	300507	苏奥传感	16,300	122,739.00	0.10
223	300722	新余国科	5,500	122,650.00	0.10
224	300457	赢合科技	5,800	122,264.00	0.10
225	301316	慧博云通	3,100	122,078.00	0.10
226	300674	宇信科技	8,100	121,905.00	0.10
227	300042	朗科科技	1,600	121,872.00	0.10
228	300363	博腾股份	7,500	121,800.00	0.10
229	300133	华策影视	17,200	121,776.00	0.10
230	301277	新天地	13,900	121,625.00	0.10
231	301171	易点天下	3,580	121,576.80	0.10
232	300452	山河药辅	10,400	121,472.00	0.10
233	300459	汤姆猫	35,800	121,362.00	0.10
234	300412	迦南科技	26,600	121,296.00	0.10
235	300525	博思软件	16,300	121,272.00	0.10
236	300046	台基股份	3,300	120,648.00	0.10

237	300353	东土科技	5,800	120,524.00	0.10
238	300065	海兰信	5,400	120,474.00	0.10
239	300182	捷成股份	25,300	120,175.00	0.10
240	301015	百洋医药	6,300	120,078.00	0.10
241	300278	华昌达	30,900	119,892.00	0.10
242	300187	永清环保	23,700	119,685.00	0.10
243	300908	仲景食品	5,400	119,016.00	0.10
244	301331	恩威医药	5,400	118,800.00	0.10
245	300678	中科信息	5,300	118,720.00	0.10
246	300413	芒果超媒	8,100	118,503.00	0.10
247	300293	蓝英装备	5,800	118,030.00	0.09
248	301102	兆讯传媒	13,800	117,990.00	0.09
249	300540	蜀道装备	3,100	117,490.00	0.09
250	301185	鸥玛软件	7,900	117,394.00	0.09
251	301219	腾远钴业	2,140	117,272.00	0.09
252	300693	盛弘股份	2,400	117,000.00	0.09
253	301314	科瑞思	2,400	116,784.00	0.09
254	300653	正海生物	8,100	116,316.00	0.09
255	301078	孩子王	17,200	116,272.00	0.09
256	300684	中石科技	1,900	115,900.00	0.09
257	300130	新国都	5,500	115,720.00	0.09
258	301311	昆船智能	8,900	115,611.00	0.09
259	300409	道氏技术	5,800	115,594.00	0.09
260	300573	兴齐眼药	2,835	115,554.60	0.09
261	300415	伊之密	5,800	115,478.00	0.09
262	300497	富祥股份	5,200	115,232.00	0.09
263	300534	陇神戎发	16,200	114,696.00	0.09
264	300170	汉得信息	7,500	114,300.00	0.09
265	300593	新雷能	3,800	114,228.00	0.09
266	300579	数字认证	5,500	113,850.00	0.09
267	301390	经纬股份	3,500	112,910.00	0.09
268	301216	万凯新材	4,900	112,651.00	0.09
269	300376	易事特	22,000	112,640.00	0.09
270	300969	恒帅股份	1,200	112,512.00	0.09
271	300709	精研科技	2,000	112,500.00	0.09
272	300439	美康生物	14,000	112,420.00	0.09
273	301069	凯盛新材	5,600	112,224.00	0.09
274	300942	易瑞生物	19,400	112,132.00	0.09
275	301060	兰卫医学	13,700	111,929.00	0.09
276	300296	利亚德	19,900	111,440.00	0.09
277	300864	南大环境	5,800	111,244.00	0.09
278	301103	何氏眼科	7,400	110,852.00	0.09
279	300775	三角防务	5,000	110,200.00	0.09
280	300891	惠云钛业	17,400	110,142.00	0.09

281	300634	彩讯股份	5,600	109,592.00	0.09
282	300134	大富科技	12,700	108,585.00	0.09
283	300883	龙利得	17,200	108,532.00	0.09
284	300687	赛意信息	3,500	108,500.00	0.09
285	300820	英杰电气	1,200	108,276.00	0.09
286	300824	北鼎股份	15,000	107,700.00	0.09
287	300641	正丹股份	7,000	107,660.00	0.09
288	300188	国投智能	11,500	107,525.00	0.09
289	300341	麦克奥迪	8,100	107,325.00	0.09
290	301091	深城交	6,900	106,950.00	0.09
291	300923	研奥股份	4,800	106,944.00	0.09
292	300387	富邦科技	15,700	106,603.00	0.09
293	301039	中集车辆	15,100	106,455.00	0.09
294	301131	聚赛龙	3,300	106,029.00	0.09
295	301382	蜂助手	2,300	105,800.00	0.08
296	301166	优宁维	4,100	105,739.00	0.08
297	300253	卫宁健康	15,700	105,661.00	0.08
298	300428	立中集团	5,800	105,444.00	0.08
299	300913	兆龙互连	2,200	105,402.00	0.08
300	300610	晨化股份	10,800	105,300.00	0.08
301	300053	航宇微	6,400	105,280.00	0.08
302	300469	信息发展	2,000	105,220.00	0.08
303	300827	上能电气	3,400	104,686.00	0.08
304	300580	贝斯特	5,200	104,572.00	0.08
305	300332	天壕能源	24,300	104,490.00	0.08
306	300291	百纳千成	21,600	104,328.00	0.08
307	300277	汽轮科技	6,900	103,776.00	0.08
308	300994	久祺股份	9,700	103,499.00	0.08
309	300569	天能重工	21,300	102,666.00	0.08
310	300779	惠城环保	2,040	102,408.00	0.08
311	300543	朗科智能	14,200	102,382.00	0.08
312	300968	格林精密	10,600	102,184.00	0.08
313	300045	华力创通	5,900	101,716.00	0.08
314	301098	金埔园林	12,400	101,680.00	0.08
315	300451	创业慧康	31,700	101,440.00	0.08
316	300645	正元智慧	8,600	101,222.00	0.08
317	300137	先河环保	5,800	101,152.00	0.08
318	300118	东方日升	8,100	100,845.00	0.08
319	300499	高澜股份	2,600	100,620.00	0.08
320	300514	友讯达	10,700	100,045.00	0.08
321	300581	晨曦航空	8,900	100,036.00	0.08
322	300855	图南股份	3,200	100,032.00	0.08
323	300917	特发服务	4,100	99,958.00	0.08
324	300625	三雄极光	11,000	99,880.00	0.08

325	300204	舒泰神	4,200	99,876.00	0.08
326	300910	瑞丰新材	3,560	99,822.40	0.08
327	300180	华峰超纤	25,300	99,682.00	0.08
328	300772	运达股份	8,100	99,630.00	0.08
329	300259	新天科技	15,000	99,450.00	0.08
330	300598	诚迈科技	3,500	99,400.00	0.08
331	300856	科思股份	9,300	99,138.00	0.08
332	300371	汇中股份	10,100	98,778.00	0.08
333	300426	华智数媒	19,500	98,670.00	0.08
334	301081	严牌股份	7,200	98,496.00	0.08
335	301130	西点药业	4,100	98,318.00	0.08
336	300823	建科智能	6,700	97,686.00	0.08
337	300718	长盛轴承	1,600	97,552.00	0.08
338	300258	精锻科技	8,800	97,064.00	0.08
339	300597	吉大通信	13,700	96,996.00	0.08
340	300929	华骐环保	9,200	96,968.00	0.08
341	300535	达威股份	7,100	96,773.00	0.08
342	300018	中元股份	7,800	96,330.00	0.08
343	301503	智迪科技	3,500	96,285.00	0.08
344	300800	力合科技	10,400	96,200.00	0.08
345	300161	华中数控	3,300	96,096.00	0.08
346	300682	朗新科技	9,700	96,030.00	0.08
347	300675	建科院	8,100	95,985.00	0.08
348	300007	汉威科技	2,500	95,500.00	0.08
349	301006	迈拓股份	7,600	95,380.00	0.08
350	300621	维业股份	15,000	95,250.00	0.08
351	300265	通光线缆	4,600	95,128.00	0.08
352	300483	首华燃气	5,400	94,932.00	0.08
353	301170	锡南科技	4,400	94,644.00	0.08
354	300777	中简科技	3,600	94,608.00	0.08
355	300626	华瑞股份	2,700	94,176.00	0.08
356	300378	鼎捷数智	2,600	93,860.00	0.08
357	301228	实朴检测	1,200	93,792.00	0.08
358	300101	振芯科技	5,800	93,786.00	0.08
359	300549	优德精密	7,200	93,744.00	0.08
360	301298	东利机械	8,100	93,717.00	0.08
361	300519	新光药业	7,900	93,615.00	0.08
362	300624	万兴科技	1,800	93,366.00	0.07
363	300322	硕贝德	3,700	93,240.00	0.07
364	301113	雅艺科技	6,240	93,038.40	0.07
365	301004	嘉益股份	3,000	93,000.00	0.07
366	301167	建研设计	7,500	92,925.00	0.07
367	300468	四方精创	4,400	92,444.00	0.07
368	300740	水羊股份	5,000	92,050.00	0.07

369	300834	星辉环材	2,200	91,960.00	0.07
370	300256	星星科技	35,200	91,872.00	0.07
371	301522	上大股份	3,500	91,595.00	0.07
372	300008	天海防务	15,100	91,506.00	0.07
373	300689	澄天伟业	1,300	91,234.00	0.07
374	300276	三丰智能	12,700	91,059.00	0.07
375	300080	易成新能	24,200	90,992.00	0.07
376	300583	赛托生物	8,100	90,963.00	0.07
377	300226	上海钢联	5,860	89,716.60	0.07
378	300486	东杰智能	4,200	89,670.00	0.07
379	301510	固高科技	2,800	89,404.00	0.07
380	301429	森泰股份	5,700	89,319.00	0.07
381	301359	东南电子	5,600	88,928.00	0.07
382	300819	聚杰微纤	1,200	88,824.00	0.07
383	300128	锦富技术	15,000	88,800.00	0.07
384	300072	海新能科	26,100	88,740.00	0.07
385	300900	广联航空	2,300	88,711.00	0.07
386	300731	科创新源	1,520	88,707.20	0.07
387	300815	玉禾田	5,400	88,290.00	0.07
388	301363	美好医疗	4,780	87,617.40	0.07
389	300113	顺网科技	4,800	87,408.00	0.07
390	300328	宜安科技	6,200	87,048.00	0.07
391	301519	舜禹股份	8,000	86,800.00	0.07
392	300669	沪宁股份	3,300	86,790.00	0.07
393	300516	久之洋	2,640	86,486.40	0.07
394	300493	润欣科技	5,800	86,478.00	0.07
395	300244	迪安诊断	4,600	86,204.00	0.07
396	300492	华图山鼎	2,500	85,875.00	0.07
397	300850	新强联	3,200	85,760.00	0.07
398	301007	德迈仕	2,800	85,680.00	0.07
399	300638	广和通	4,600	85,146.00	0.07
400	300228	富瑞特装	11,500	85,100.00	0.07
401	300838	浙江力诺	6,300	84,105.00	0.07
402	300035	中科电气	5,800	83,636.00	0.07
403	300696	爱乐达	3,200	83,296.00	0.07
404	300417	南华仪器	8,100	83,106.00	0.07
405	301187	欧圣电气	5,800	82,998.00	0.07
406	300082	奥克股份	9,600	82,848.00	0.07
407	300348	长亮科技	9,400	82,720.00	0.07
408	300756	金马游乐	2,500	82,625.00	0.07
409	300048	合康新能	17,600	82,192.00	0.07
410	300872	天阳科技	5,200	82,160.00	0.07
411	300755	华致酒行	7,200	82,008.00	0.07
412	301327	华宝新能	1,700	81,719.00	0.07

413	300254	仟源医药	10,200	81,702.00	0.07
414	300049	福瑞医科	2,100	81,648.00	0.07
415	300520	科大国创	3,000	80,820.00	0.06
416	301256	华融化学	6,200	80,352.00	0.06
417	301000	肇民科技	2,500	80,025.00	0.06
418	301061	匠心家居	2,230	78,206.10	0.06
419	300680	隆盛科技	3,440	78,156.80	0.06
420	300337	银邦股份	6,700	78,122.00	0.06
421	300851	交大思诺	3,500	77,875.00	0.06
422	300792	壹网壹创	3,000	77,820.00	0.06
423	300981	中红医疗	8,100	77,517.00	0.06
424	300153	科泰电源	3,400	76,908.00	0.06
425	300043	星辉娱乐	17,400	75,690.00	0.06
426	300210	森远股份	8,900	75,472.00	0.06
427	301286	侨源股份	1,300	75,387.00	0.06
428	300766	每日互动	3,500	74,900.00	0.06
429	300324	旋极信息	20,100	74,772.00	0.06
430	300846	首都在线	3,500	74,235.00	0.06
431	300617	安靠智电	1,400	74,186.00	0.06
432	301268	铭利达	5,300	74,094.00	0.06
433	301606	绿联科技	1,200	73,224.00	0.06
434	300997	欢乐家	5,300	71,815.00	0.06
435	300632	光莆股份	2,500	71,375.00	0.06
436	300983	尤安设计	2,000	71,200.00	0.06
437	300444	双杰电气	5,800	70,818.00	0.06
438	300547	川环科技	2,100	70,119.00	0.06
439	300918	南山智尚	6,500	69,680.00	0.06
440	300139	晓程科技	1,900	69,445.00	0.06
441	300648	星云股份	1,600	69,152.00	0.06
442	300191	潜能恒信	2,500	69,125.00	0.06
443	300215	电科院	10,400	68,536.00	0.05
444	300745	欣锐科技	1,600	67,552.00	0.05
445	300393	中来股份	9,100	66,339.00	0.05
446	301137	哈焊华通	1,900	65,284.00	0.05
447	300129	泰胜风能	7,500	64,125.00	0.05
448	301012	扬电科技	2,700	63,423.00	0.05
449	300895	铜牛信息	1,200	62,448.00	0.05
450	300490	华自科技	4,700	62,181.00	0.05
451	301291	明阳电气	1,700	61,183.00	0.05
452	300421	力星股份	3,300	61,083.00	0.05
453	300905	宝丽迪	1,200	60,720.00	0.05
454	300368	汇金股份	7,200	60,120.00	0.05
455	300986	志特新材	3,500	60,025.00	0.05
456	300004	南风股份	5,900	59,590.00	0.05

457	300063	天龙集团	6,600	57,288.00	0.05
458	300619	金银河	1,820	56,620.20	0.05
459	300539	横河精密	2,700	54,999.00	0.04
460	300571	平治信息	1,200	54,792.00	0.04
461	300300	海峡创新	7,000	54,670.00	0.04
462	301155	海力风电	1,200	51,480.00	0.04
463	300652	雷迪克	1,500	50,265.00	0.04
464	300461	田中精机	1,300	48,152.00	0.04
465	300785	值得买	1,300	47,671.00	0.04
466	300164	通源石油	5,800	46,400.00	0.04
467	300290	ST 荣科	6,300	41,895.00	0.03
468	300087	ST 荃银	4,800	25,824.00	0.02
469	301531	春光集团	256	13,199.36	0.01
470	300381	溢多利	2,000	11,240.00	0.01
471	301599	理奇智能	333	10,812.51	0.01
472	300074	华平股份	2,700	9,180.00	0.01
473	301669	高特电子	303	8,605.20	0.01
474	300112	万讯自控	1,200	7,428.00	0.01
475	300359	全通教育	2,000	7,160.00	0.01
476	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.01
477	300369	绿盟科技	1,200	6,528.00	0.01

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	001399	惠科股份	662.00	18,357.26	0.01
2	001365	天海电子	200.00	6,262.00	0.01
3	001393	维通利	147.00	5,731.53	0.00
4	001237	惠康科技	81.00	4,757.94	0.00
5	001312	福恩股份	96.00	1,610.88	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	300502	新易盛	2,375,413.00	0.72
2	300476	胜宏科技	1,778,325.00	0.54
3	300308	中际旭创	1,663,483.00	0.50
4	300394	天孚通信	1,472,781.00	0.44

5	301308	江波龙	883,647.00	0.27
6	300750	宁德时代	644,390.00	0.19
7	301090	华润材料	575,898.00	0.17
8	300482	万孚生物	562,599.00	0.17
9	300124	汇川技术	552,406.00	0.17
10	301358	湖南裕能	531,458.00	0.16
11	300274	阳光电源	528,386.00	0.16
12	300034	钢研高纳	499,305.00	0.15
13	300376	易事特	467,162.00	0.14
14	301102	兆讯传媒	460,860.00	0.14
15	300161	华中数控	457,593.00	0.14
16	300576	容大感光	443,951.60	0.13
17	300302	同有科技	432,285.00	0.13
18	300687	赛意信息	415,557.00	0.13
19	300601	康泰生物	408,723.00	0.12
20	300400	劲拓股份	408,384.00	0.12

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	300502	新易盛	954,727.00	0.29
2	300476	胜宏科技	844,975.00	0.26
3	300394	天孚通信	772,274.00	0.23
4	300246	宝莱特	567,455.00	0.17
5	301308	江波龙	519,510.00	0.16
6	300750	宁德时代	512,343.00	0.15
7	300308	中际旭创	500,435.00	0.15
8	300026	红日药业	492,968.00	0.15
9	300594	ST 朗进	476,174.00	0.14
10	301047	义翘神州	474,147.00	0.14
11	301588	美新科技	460,679.00	0.14
12	300880	迦南智能	460,610.00	0.14
13	300780	德恩精工	456,831.00	0.14
14	301395	仁信新材	446,625.00	0.13
15	300712	永福股份	439,360.00	0.13
16	300654	世纪天鸿	436,742.00	0.13
17	300317	珈伟新能	435,153.00	0.13
18	300212	*ST 易录	429,663.00	0.13
19	300238	冠昊生物	427,747.00	0.13
20	300685	艾德生物	423,250.00	0.13

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	86,591,467.91
卖出股票的收入（成交）总额	85,496,861.55

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	60,492.63

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五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	占基金资产净值	流通受限情况说明
----	------	------	---------	---------	----------

			公允价值	比例(%)	
1	001399	惠科股份	18,357.26	0.01	首次公开发行限售
2	001365	天海电子	6,262.00	0.01	首次公开发行限售
3	001393	维通利	5,731.53	0.00	首次公开发行限售
4	001237	惠康科技	4,757.94	0.00	首次公开发行限售
5	001312	福恩股份	1,610.88	0.00	首次公开发行限售

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		博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
824	113,554.31	7,523,693.00	8.04%	14,094,833.00	15.06%	71,950,227.00	76.90%

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（2025 年 8 月 15 日）基金份额总额	421,568,753.00
--------------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	305,568,753.00
本报告期基金总申购份额	96,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	308,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	93,568,753.00

§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，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

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

本基金自基金合同生效日起，聘请容诚会计师事务所(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

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

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

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	3	171,815,041.29	100.00%	31,943.18	100.00%	增加 3 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。

10.7.2 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	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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	博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金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	博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-05-30
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	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	2026-05-13
5	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
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	博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金 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	博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金 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	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-25
11	博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示及停复牌公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-18
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

		露网站	
14	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增国联民生证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-10
15	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
16	博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金 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

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
中国工商银行股份有限公司—博时创业板综合	1	2026-01-01~2026-06-30	265,939,927.00	70,612,300.00	264,602,000.00	71,950,227.00	76.90%

交易型 开放式 指数证 券投资 基金联 接基金						
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创业板综合交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 2、《博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《博时创业板综合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、博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时创业板综合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