博时中证软件服务指数型发起式证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时中证软件服务指数发起式
基金主代码	019503
基金运作方式	普通开放式
基金合同生效日	2023 年 12 月 26 日
报告期末基金份额总额	111,329,885.00 份
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。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 0.35%，预期年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股长期停牌；（4）其它合理原因导致本基

	金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。本基金的投资策略还包括债券（除可转换债券和可交换债券）投资策略、港股通标的股票投资策略、资产支持证券的投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、衍生品投资策略、融资及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	本基金业绩比较基准为：中证软件服务指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。	
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，跟踪中证软件服务指数，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。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。	
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	
下属分级基金的基金简称	博时中证软件服务指数发起式 A	博时中证软件服务指数发起式 C
下属分级基金的交易代码	019503	019504
报告期末下属分级基金的份额总额	37,340,696.77 份	73,989,188.23 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)	
	博时中证软件服务指数发起式 A	博时中证软件服务指数发起式 C
1.本期已实现收益	-224,849.17	-484,941.54
2.本期利润	-2,586,635.56	-4,801,712.92
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0727	-0.0698

4.期末基金资产净值	32,182,488.07	63,145,646.25
5.期末基金份额净值	0.8619	0.8534

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不包含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1．博时中证软件服务指数发起式A：

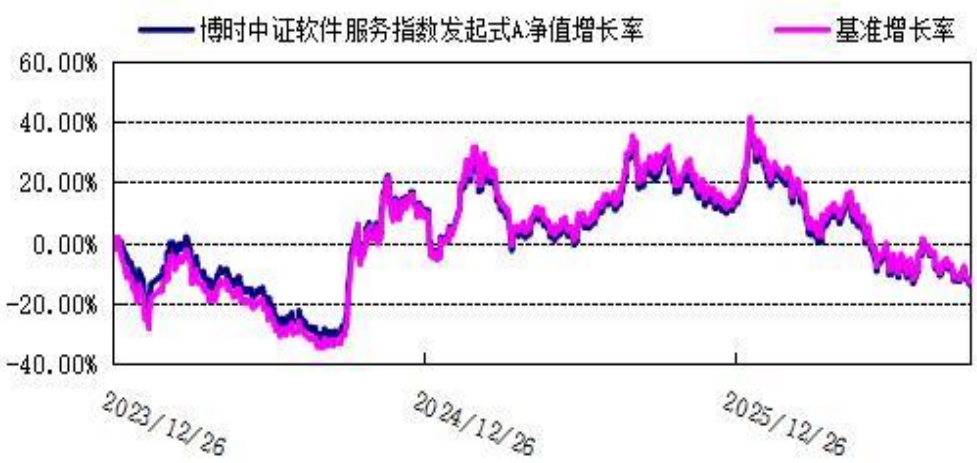
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-6.49%	1.88%	-7.10%	1.87%	0.61%	0.01%
过去六个月	-16.03%	2.00%	-16.92%	2.00%	0.89%	0.00%
过去一年	-31.65%	1.96%	-32.41%	1.97%	0.76%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-13.81%	2.17%	-12.93%	2.25%	-0.88%	-0.08%

2．博时中证软件服务指数发起式C：

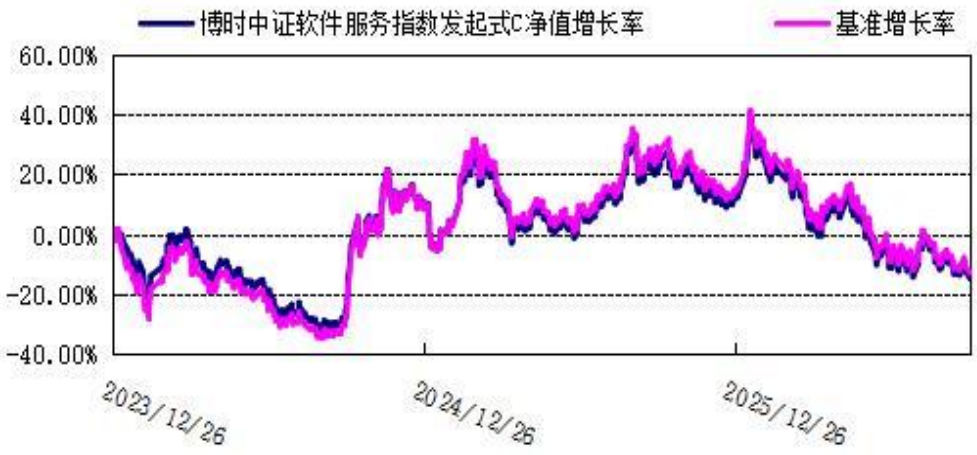
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-6.57%	1.88%	-7.10%	1.87%	0.53%	0.01%
过去六个月	-16.16%	2.00%	-16.92%	2.00%	0.76%	0.00%
过去一年	-31.86%	1.96%	-32.41%	1.97%	0.55%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-14.66%	2.17%	-12.93%	2.25%	-1.73%	-0.08%

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

1．博时中证软件服务指数发起式A：



2．博时中证软件服务指数发起式C：



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尹浩	基金经理	2023-12-26	-	14.2	尹浩先生，硕士。2012 年起先后在华宝证券、国金证券工作。2015 年加入博时基金管理有限公司。历任高级研究员、高级研究员兼基金经理助理、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(2019 年 10 月 11 日-2023 年 3 月 8 日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 10 月 11 日-2023 年 3 月 8 日)、博时中证 5G 产业

					50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2021 年 7 月 14 日-2024 年 8 月 17 日)、博时中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2021 年 11 月 30 日-2025 年 1 月 15 日)、博时中证 A100 指数型证券投资基金(2024 年 12 月 25 日-2025 年 6 月 23 日)的基金经理。现任博时创业板交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 10 月 11 日—至今)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019 年 10 月 11 日—至今)、博时中证 5G 产业 50 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 3 月 27 日—至今)、博时中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 12 月 10 日—至今)、博时中证智能消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 12 月 30 日—至今)、博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 7 月 15 日—至今)、博时中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 8 月 19 日—至今)、博时中证金融科技主题交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 9 月 24 日—至今)、博时国证龙头家电交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 12 月 13 日—至今)、博时中证湖北新旧动能转换交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 12 月 29 日—至今)、博时中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金(2022 年 7 月 1 日—至今)、博时中证成渝地区双城经济圈成份交易型开放式指数证券投资基金(2022 年 8 月 15 日—至今)、博时中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2023 年 1 月 6 日—至今)、博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2023 年 11 月 28 日—至今)、博时中证软件服务指数型发起式证券投资基金(2023 年 12 月 26 日—至今)、博时中证半导体产业交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 4 月 8 日—至今)、博时国证龙头家电交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2024 年 5 月 28 日

					—至今)、博时中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 6 月 16 日—至今)、博时中证金融科技主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2025 年 6 月 19 日—至今)、博时中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2025 年 6 月 24 日—至今)的基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 11 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年三季度，中国经济延续“外需韧性、内需偏弱、结构分化”的特征。生产端保持韧性，规模以上工业增加值 8 月同比增速相对 7 月有所提升；价格端再通胀延续，PPI 同比由 7 月的 3.5%升至 8 月的 3.8%，CPI 同比由 0.5%升至 0.8%；需求端修复动能不足，社零当月同比由 0.6%回落至 0.4%，社融存量增速由 7.4%降至 7.2%；出口维持高景气，8 月当月美元计出口同比由 23.9%升至 25.0%；货币政策保持“适度宽松”。海外方面，美伊冲突升级推升油价；美联储 9 月重启加息 25 个基点（为 2023 年 7 月以来首次），欧央行 9 月

亦加息 25 个基点，全球流动性阶段性收紧，长端美债利率显著上行；海外 AI 产业趋势延续，北美四大云厂商二季度资本开支同比增长延续。A 股三季度呈现“震荡调整、风格再平衡”特征，科技成长深度回撤，科创 50、创业板指跌幅显著；资源红利逆势占优。本基金为被动跟踪指数的基金，其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差，取得标的指数所代表的市场平均回报。

展望四季度，国内“稳中求进”政策基调延续，9 月底国常会强调加大宏观政策逆周期调节，三部门联合发文对个人住房贷款贴息，政策加码与盈利修复有望成为主线。对于软件行业，大模型能力突破与成本下降有望推动 AI 应用空间打开，看好数据、Infra、行业软件等方向。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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 09 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 0.8619 元，份额累计净值为 0.8619 元，本基金 C 类基金份额净值为 0.8534 元，份额累计净值为 0.8534 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-6.49%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-6.57%，同期业绩基准增长率为-7.10%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	89,539,543.28	93.20
	其中：股票	89,539,543.28	93.20
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	6,228,057.90	6.48
8	其他各项资产	308,332.64	0.32
9	合计	96,075,933.82	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	77,110,519.32	80.89
J	金融业	12,429,023.96	13.04
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	89,539,543.28	93.93

5.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

无。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	002230	科大讯飞	273,001	10,161,097.22	10.66
2	300033	同花顺	42,800	8,434,168.00	8.85
3	688111	金山办公	33,001	7,220,618.80	7.57
4	300454	深信服	36,800	5,057,056.00	5.30
5	601360	三六零	497,300	4,450,835.00	4.67
6	002261	拓维信息	179,000	4,245,880.00	4.45
7	600570	恒生电子	215,200	4,174,880.00	4.38
8	300803	指南针	75,332	3,994,855.96	4.19
9	300339	润和软件	113,200	3,826,160.00	4.01
10	301236	软通动力	88,200	3,107,286.00	3.26

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

无。

5.4 报告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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，三六零安全科技股份有限公司在报告编制前一年受到三门峡市生态环境局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,284.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	294,048.04
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	308,332.64

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时中证软件服务指数发起式A	博时中证软件服务指数发起式C
本报告期期初基金份额总额	31,393,623.39	59,612,839.08
报告期期间基金总申购份额	12,896,262.97	66,559,455.20
减：报告期期间基金总赎回份额	6,949,189.59	52,183,106.05
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	37,340,696.77	73,989,188.23

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	博时中证软件服务指数发起式A	博时中证软件服务指数发起式C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,658.90	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,658.90	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	26.78	-

注：1.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）。

2.基金管理人博时基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,658.90	8.98%	10,000,658.90	8.98%	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股	-	-	-	-	-

东					
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,658.90	8.98%	10,000,658.90	8.98%	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“创造财富，共赴未来”是公司的使命。公司的投资理念是“投资价值发现者”。截至 2026 年 9 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 406 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 16,913 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,744 亿元人民币，累计分红逾 2,335 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会批准博时中证软件服务指数型发起式证券投资基金设立的文件

2、《博时中证软件服务指数型发起式证券投资基金基金合同》

3、《博时中证软件服务指数型发起式证券投资基金托管协议》

4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

5、博时中证软件服务指数型发起式证券投资基金各年度审计报告正本

6、报告期内博时中证软件服务指数型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日