博时回报严选混合型证券投资基金

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	博时回报严选混合
基金主代码	014600
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 2 月 8 日
报告期末基金份额总额	100,051,725.10 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为偏股混合型基金。投资策略主要包括大类资产配置策略、股票投资策略、其他资产投资策略三个部分内容。其中，大类资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，动态调整大类资产配置比例，以争取规避系统性风险。其次，股票投资策略包括个股选择策略、港股通标的股票投资策略和存托凭证投资策略。其他资产投资策略有债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资业务的投资策略、流通受限证券投资策略等。本基金在个股选择上采用定量和定性分析相结合的策略，以创新发展为理念指导，聚焦以科技进步和数字经济为代表的新兴产业、进行科

	技赋能和转型升级的传统产业，基于行业比较分析、企业战略规划及核心竞争力分析等方法，严格筛选具备良好发展前景和企业价值稳健增长的企业进行投资，重点关注企业的业务成长性、商业模式的可持续性和外延性，积极把握科技与产业结合带来的投资机会，持续分享创新带来的产业成长红利。	
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率*75%＋中证港股通综合指数（人民币）收益率*15%＋中债-国债总财富（1-3 年）指数收益率*5%+活期存款基准利率*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。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	博时回报严选混合 A	博时回报严选混合 C
下属分级基金的交易代码	014600	014601
报告期末下属分级基金的份额总额	60,396,508.79 份	39,655,216.31 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)	
	博时回报严选混合 A	博时回报严选混合 C
1.本期已实现收益	30,169,578.05	19,444,695.49
2.本期利润	-57,048,062.77	-37,253,130.52
3.加权平均基金份额本期利润	-0.9104	-0.9122
4.期末基金资产净值	109,812,753.88	70,454,932.46

5.期末基金份额净值	1.8182	1.7767

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．博时回报严选混合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	-32.50%	3.84%	-13.19%	1.22%	-19.31%	2.62%
过去六个月	16.09%	3.44%	-6.18%	1.21%	22.27%	2.23%
过去一年	18.34%	2.89%	-13.26%	1.15%	31.60%	1.74%
过去三年	133.13%	2.39%	17.48%	1.23%	115.65%	1.16%
自基金合同生效起至今	81.82%	2.16%	-0.03%	1.17%	81.85%	0.99%

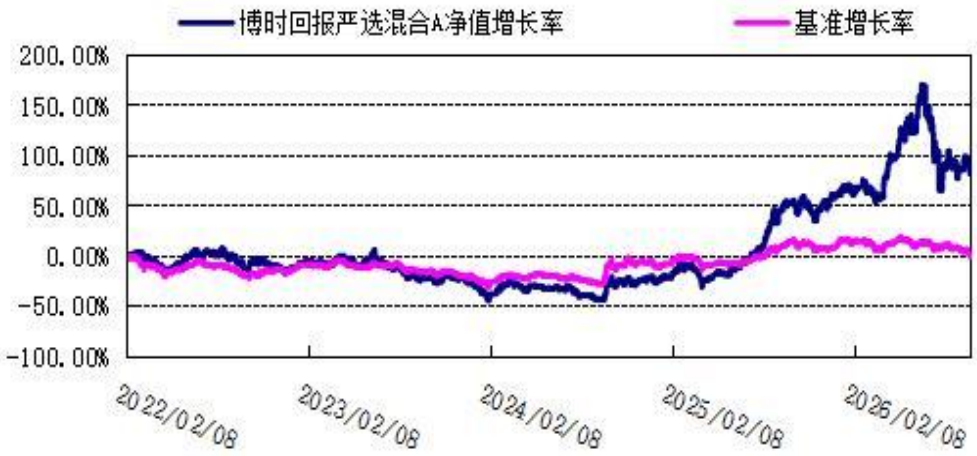
2．博时回报严选混合C：

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	-32.59%	3.84%	-13.19%	1.22%	-19.40%	2.62%
过去六个月	15.80%	3.44%	-6.18%	1.21%	21.98%	2.23%
过去一年	17.76%	2.89%	-13.26%	1.15%	31.02%	1.74%
过去三年	129.67%	2.39%	17.48%	1.23%	112.19%	1.16%
自基金合同生效起至今	77.67%	2.16%	-0.03%	1.17%	77.70%	0.99%

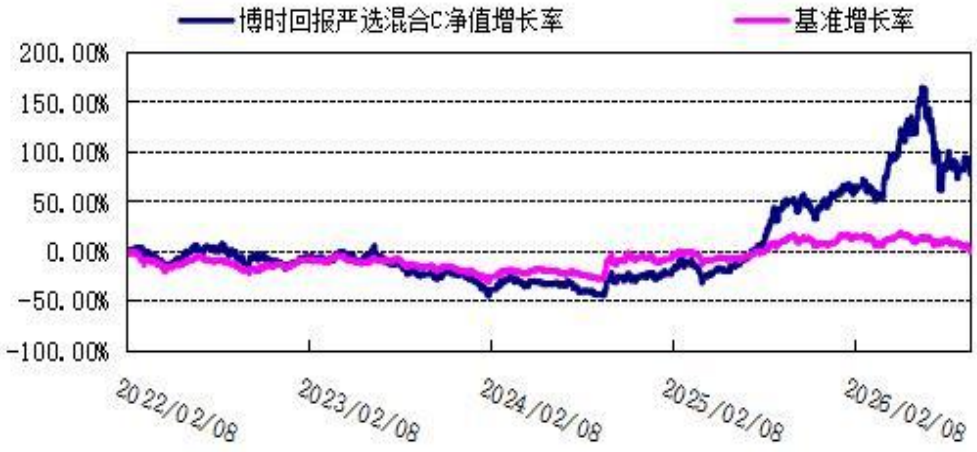
注：自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 创新驱动指数收益率*70%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*15%+中债综合财富(总值)指数收益率*15%”调整为“中国战略新兴产业成份指数收益率*75%＋中证港股通综合指数（人民币）收益率*15%＋中债-国债总财富（1-3 年）指数收益率*5%+活期存款基准利率*5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

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．博时回报严选混合A：



2．博时回报严选混合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		
吴渭	权益投资四部投资副总监/基金经理	2026-07-03	-	19.2	吴渭先生，硕士。2007 年起先后在泰信基金、博时基金、民生加银基金、招商基金从事投资研究工作。2015 年 3 月再次加入博时基金管理有限公司。历任股票投资部绝对收益组投资副总监、股票投资部主题组投资副总监、事业部投资副总监、权益投资主题组投资副总监、博时汇誉回报灵活配置混合型证券投资基金(2021 年 4 月 29 日-2023 年 2 月 1 日)、

					博时恒玺一年持有期混合型证券投资基金(2021 年 7 月 6 日-2023 年 2 月 8 日)、博时汇悦回报混合型证券投资基金(2019 年 1 月 29 日-2023 年 4 月 14 日)、博时博盈稳健 6 个月持有期混合型证券投资基金(2021 年 8 月 10 日-2023 年 4 月 14 日)、博时汇融回报一年持有期混合型证券投资基金(2021 年 1 月 20 日-2023 年 5 月 15 日)的基金经理。现任权益投资四部投资副总监兼博时汇智回报灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 4 月 12 日—至今)、博时汇兴回报一年持有期灵活配置混合型证券投资基金(2021 年 1 月 14 日—至今)、博时汇荣回报灵活配置混合型证券投资基金(2021 年 8 月 24 日—至今)、博时回报严选混合型证券投资基金(2026 年 7 月 3 日—至今)、博时半导体主题混合型证券投资基金(2026 年 7 月 15 日—至今)、博时创新精选混合型证券投资基金(2026 年 7 月 15 日—至今)的基金经理。
肖瑞瑾	权益投资四部投资总监助理/基金经理	2022-02-08	2026-07-03	14.2	肖瑞瑾先生，硕士。2012 年从复旦大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员、高级研究员兼基金经理助理、资深研究员兼基金经理助理、博时灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 8 月 1 日-2018 年 3 月 9 日)、博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 1 月 5 日-2019 年 6 月 21 日)、博时特许价值混合型证券投资基金(2018 年 6 月 21 日-2021 年 4 月 13 日)、博时汇悦回报混合型证券投资基金(2020 年 2 月 20 日-2021 年 4 月 13 日)的基金经理、权益投资主题组投资总监助理、博时消费创新混合型证券投资基金(2020 年 10 月 23 日-2021 年 11 月 8 日)、博时创业板两年定期开放混合型证券投资基金(2020 年 9 月 3 日-2021 年 12 月 14 日)、博时时代消费混合型证券投资基金(2021 年 12 月 21 日-2024 年 6 月 28 日)、博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金(2023 年 4 月 4 日-2024 年 6 月 28 日)、博时科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）(2019

					年 6 月 27 日-2024 年 7 月 3 日)、博时科技创新混合型证券投资基金(2020 年 4 月 15 日-2024 年 7 月 3 日)、博时回报严选混合型证券投资基金(2022 年 2 月 8 日-2026 年 7 月 3 日)、博时创新精选混合型证券投资基金(2021 年 3 月 9 日-2026 年 7 月 15 日)、博时半导体主题混合型证券投资基金(2021 年 7 月 20 日-2026 年 7 月 15 日)、博时回报灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 8 月 14 日-2026 年 8 月 5 日)、博时科创板三年定期开放混合型证券投资基金(2020 年 7 月 29 日-2026 年 8 月 5 日)、博时数字经济混合型证券投资基金(2021 年 6 月 18 日-2026 年 8 月 14 日)、博时成长回报混合型证券投资基金(2021 年 12 月 3 日-2026 年 8 月 14 日)的基金经理。现任权益投资四部投资总监助理。

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，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 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，A 股市场整体呈现震荡调整格局，结构分化极为显著。经历了上半年以 AI 算力为代表的科技成长风格大幅上涨后，三季度市场在海外利率冲击、科技赛道拥挤出清和地缘风险升温的共同作用下，走出了"急跌—反弹—缩量回落"的三段式走势。上证指数三季度下跌 6.16%，沪深 300 下跌 12.49%，而创业板指和科创 50 分别下跌 27.80%和 30.70%，跌幅居前。风格层面，价值与成长呈现极致分化：300 价值指数逆势上涨 5.92%，而 300 成长指数下跌 20.28%，两者差距超过 26 个百分点，为近年来罕见的风格逆转。

市场层面，三季度行业表现呈现鲜明的"防御主导、科技退潮"特征。以煤炭、石油石化为代表的能源资源板块领涨全市场，煤炭行业三季度上涨 19.29%，受益于供给端收缩、夏季用电高峰以及中东地缘冲突推升能源价格，叠加高股息防御属性吸引避险资金流入。银行板块上涨 14.56%，在利率上行周期中受益于息差改善预期，叠加低估值、高股息和财政部 3000 亿增资利好。农林牧渔板块异军突起，上涨 15.10%，受全球粮食危机预期和低位估值修复驱动。医药生物上涨 10.12%，受益于"十五五"医药工业规划等政策催化。与之形成鲜明对照的是，电子行业下跌 32.65%，通信行业下跌 28.72%，电力设备、机械设备、建筑材料跌幅均超 20%。前期涨幅大的 AI 算力、半导体等科技赛道，在海外科技股情绪传导、机构持仓高度集中和融资盘集中出清的压力下，经历了剧烈的估值回归。值得关注的是，产业基本面与股价出现阶段性背离：例如，光通信行业上半年净利润同比增长约 2.5 倍，但三季度股价大幅回调，反映估值与情绪因素的短期冲击大于基本面变化。

宏观经济方面，三季度国内经济呈现"外强内弱"的格局。9 月制造业 PMI 回升至 50.1%，重返扩张区间，较 7 月的 49.2%连续两个月改善，新订单指数同步回暖，表明政策托底效果逐步显现。出口延续强劲态势，7 月和 8 月出口同比增速分别达到 23.9%和 25.0%，为经济增长提供核心支撑。然而内需仍然偏弱：1 至 8 月规模以上工业企业利润累计同比增长 15.7%，较 1 至 7 月的 17.6%有所回落，8 月单月利润增速从 7 月的 11.2%骤降至 4.2%，反映企业盈利动能边际减弱。消费复苏乏力，8 月社会消费品零售总额同比仅增长 0.4%，居民消费意愿有待提振。房地产市场仍处于深度调整之中，1 至 8 月全国新建商品房销售面积同比下降 12.1%，降幅较 1 至 7 月扩大 0.3 个百分点，房地产开发投资同比下降 19.9%，行业仍在筑底。

流动性方面，三季度国内政策利率全面维持不变，1 年期 LPR 维持 3.00%、5 年期 LPR 维持 3.50%，MLF 和 7 天逆回购利率均未调整，三季度未实施降准降息。但政策信号逐步趋松：7 月政治局会议提出"综合运用并适时调整货币政策工具"，9 月货币政策委员会例会删除"跨周期"表述，聚焦"加大逆周期调节力度"，

新增"综合运用并适时调整货币政策工具"表述，市场对四季度降准降息的预期升温。信贷数据层面，7 月新增人民币贷款出现罕见的-3,400 亿元，8 月也仅为 600 亿元，居民部门持续去杠杆，反映实体经济融资需求偏弱。8 月末 M2 同比增长 7.5%，M1 同比增长 4.1%，剪刀差维持-3.4 个百分点的深度负值区间，表明"宽货币"向"宽信用"传导不畅，资金活性不足。债券市场方面，三季度十年期国债收益率从 1.744%震荡下行至 1.683%，下行约 6 个基点，国债期货价格中枢上移，反映市场对经济基本面的谨慎预期和宽松预期。

海外方面，美联储在 9 月议息会议上宣布加息 25 个基点，将联邦基金利率目标区间上调至 3.75%-4.00%，为 2023 年 7 月以来首次加息。美联储点阵图显示年内可能再加息一次，2027 年利率中枢维持 4.1%，"更高更久"的利率格局进一步夯实。美国就业市场动能减弱，三季度月均新增非农就业仅约 5 万人，但失业率维持 4.1%-4.2%低位，核心 PCE 通胀突破 3.0%，粘性超预期。与此同时，欧央行 9 月加息 25bp 至 2.50%，日央行 9 月加息 25bp 至 1.25%，美欧日三大央行形成 2023 年以来首次"紧缩共振"。中美经贸关系方面，9 月何立峰副总理赴美磋商达成 300 亿美元对等降税安排，但对华实际有效关税仍高达 21.5%，11 月关税休战到期是四季度关键变量。在海外利率高企的背景下，三季度十年期美债收益率从 4.48%飙升至 5.29%，上行 81 个基点，对全球成长类资产估值形成系统性压制，这也是三季度 A 股科技板块大幅回调的核心外部驱动。

在综合分析宏观经济、流动性和产业基本面后，我们预计 2026 年四季度 A 股市场有望呈现震荡分化、结构修复的格局。从积极因素看，三季度杠杆资金大幅出清——融资余额从 3 万亿降至约 1.3 万亿，降幅达 56.7%，ETF 呈现逆势净流入，杠杆风险与拥挤交易风险已相对出清；9 月 PMI 重返扩张区间释放经济边际改善信号；央行货币政策委员会例会释放明确宽松信号，四季度降准降息概率提升。从风险因素看，海外高利率环境短期难以逆转，美债收益率高位运行对成长股估值的压制仍将存在；国内信贷需求偏弱、消费复苏乏力、房地产持续调整等结构性问题仍需时间化解。展望四季度，随着国内货币政策进一步宽松落地、海外加息周期趋于尾声以及年末估值切换行情的展开，A 股市场有望逐步修复三季度的悲观定价，科技创新和自主可控方向的中长期投资机会值得持续跟踪和重点布局。

行业配置角度，我们仍然看好经历深度调整后估值已回落至历史低位的 AI 算力硬件产业链，包括光模块、PCB、半导体和存储等细分领域，产业景气度仍然强劲，股价与基本面的背离提供了中长期布局窗口。本轮牛市和科技是强绑定关系，周期级别的拐点较可能发生在杀逻辑的时间窗口，而短期的拐点取决于多方面因素，比如监管降温、去杠杆，高杠杆崩塌引发全球科技股动荡的蝴蝶效应。AI 和过往所有产业趋势最大的不同在于，想象力足够丰富、空间足够广阔，因此中途波动必然也会更大。过去两年，AI 大部分的投资机会来自 PE 的增长，往后来看，许多标的的投资范式需要更多切换到赚 EPS 的增长，难度必然是加大的。AI 内部细分方向上，26 年上半场主线在通胀，下半场需弱化总量，重视结构，与总量脱钩、从 0 到 1、抗通缩的新技术值得重点关注。

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 1.8182 元，份额累计净值为 1.8182 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.7767 元，份额累计净值为 1.7767 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-32.50%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-32.59%，同期业绩基准增长率为-13.19%。

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	164,822,477.30	90.83
	其中：股票	164,822,477.30	90.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	441,009.26	0.24
	其中：债券	441,009.26	0.24
	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	15,877,678.66	8.75
8	其他各项资产	329,407.29	0.18
9	合计	181,470,572.51	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 2,985,756.44 元，净值占比 1.66%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
B	采矿业	19,935.05	0.01
C	制造业	161,626,212.03	89.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	78,446.66	0.04
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	112,127.12	0.06
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	161,836,720.86	89.78

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	2,985,756.44	1.66
合计	2,985,756.44	1.66

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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

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	688025	杰普特	39,919	16,744,024.55	9.29
2	688028	沃尔德	150,572	16,508,714.08	9.16
3	300843	胜蓝股份	136,000	16,294,160.00	9.04
4	300776	帝尔激光	104,700	13,496,877.00	7.49
5	600183	生益科技	90,200	11,722,392.00	6.50
6	688498	源杰科技	6,179	9,966,727.00	5.53
7	688037	芯源微	30,331	9,926,426.37	5.51
8	300394	天孚通信	34,100	8,892,257.00	4.93
9	688630	芯碁微装	20,730	8,057,336.40	4.47
10	688409	富创精密	44,045	7,492,054.50	4.16

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	441,009.26	0.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	441,009.26	0.24

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	123271	通合转债	2,691	441,009.26	0.24

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

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。

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	109,436.65
2	应收证券清算款	52,673.87
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	167,296.77
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	329,407.29

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	博时回报严选混合A	博时回报严选混合C
本报告期期初基金份额总额	67,534,214.40	43,438,537.98
报告期期间基金总申购份额	4,851,810.70	10,092,194.21
减：报告期期间基金总赎回份额	11,989,516.31	13,875,515.88
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	60,396,508.79	39,655,216.31

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会批准博时回报严选混合型证券投资基金设立的文件

2、《博时回报严选混合型证券投资基金基金合同》

3、《博时回报严选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、博时回报严选混合型证券投资基金各年度审计报告正本

6、报告期内博时回报严选混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日