

博时中证 800 指数增强型证券投资基金

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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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	6
2.5 其他相关资料	6
§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	9
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	11
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	12
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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53

7.12 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	55
§9 开放式基金份额变动	55
§10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
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	57
10.8 其他重大事件	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
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	博时中证 800 指数增强型证券投资基金	
基金简称	博时中证 800 指数增强	
基金主代码	023616	
交易代码	023616	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 9 月 2 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	23,380,364.95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时中证 800 指数增强 A	博时中证 800 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023616	023617
报告期末下属分级基金的份额总额	11,101,489.84 份	12,278,875.11 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化方法进行组合管理和风险控制，在力求对标的指数中证 800 指数有效跟踪的基础上，力争实现超越基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.50%，年跟踪误差不超过 7.5%。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。本基金的股票投资策略包括：1、指数化投资策略。本基金将运用指数化的投资方法，通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离，实现跟踪误差控制目标，达到对标的指数的跟踪目标。2、投资组合构建和优化。本基金将以博时数量化模型对股票的回报预测为基础，综合考虑组合与业绩比较基准的跟

	跟踪误差、行业偏离、交易成本等，进行投资组合构建和优化。投资组合的股票选择将以指数成份股及备选成份股为主，并根据博时数量化模型对股票的回报预测，优先选择成份股和非成份股中综合评估较高的股票，对指数中的股票权重进行调整，以达到指数增强的目的。 3、指数增强策略。本基金主要通过博时数量化模型对股票进行综合评定，结合风险控制模型，在控制投资组合风险预算下，对股票组合进行优化，力争获得超越业绩比较基准的回报。 4、港股投资策略。本基金将充分挖掘内地与香港股票市场交易互联互通、资金双向流动机制下 A 股市场和港股市场的投资机会。 5、存托凭证投资策略。本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。其他投资策略包括：债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	中证 800 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。本基金为股票型指数增强基金，跟踪中证 800 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。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	汪小敏
	联系电话	0755-83169999	021-31888888
	电子邮箱	service@bosera.com	wangxm8@spdb.com.cn
客户服务电话		95105568	95528
传真		0755-83195140	021-63602540
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	上海市中山东一路 12 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	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋

邮政编码	518040	200126
法定代表人	张东	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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）	
	博时中证 800 指数增强 A	博时中证 800 指数增强 C
本期已实现收益	3,606,066.54	2,381,322.86
本期利润	3,673,067.58	2,644,559.21
加权平均基金份额本期利润	0.1770	0.1692
本期加权平均净值利润率	16.18%	15.47%
本期基金份额净值增长率	13.10%	12.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	博时中证 800 指数增强 A	博时中证 800 指数增强 C
期末可供分配利润	1,974,010.69	2,147,555.61

期末可供分配基金份额利润	0.1778	0.1749
期末基金资产净值	13,099,560.46	14,452,605.80
期末基金份额净值	1.1800	1.1770
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	博时中证 800 指数增强 A	博时中证 800 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	18.00%	17.70%

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

博时中证 800 指数增强 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	13.76%	1.28%	13.02%	1.27%	0.74%	0.01%
过去六个月	13.10%	1.18%	10.59%	1.18%	2.51%	0.00%
自基金合同生效起至今	18.00%	1.06%	13.82%	1.10%	4.18%	-0.04%

博时中证 800 指数增强 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	13.66%	1.28%	13.02%	1.27%	0.64%	0.01%
过去六个月	12.93%	1.18%	10.59%	1.18%	2.34%	0.00%
自基金合同生效起至今	17.70%	1.06%	13.82%	1.10%	3.88%	-0.04%

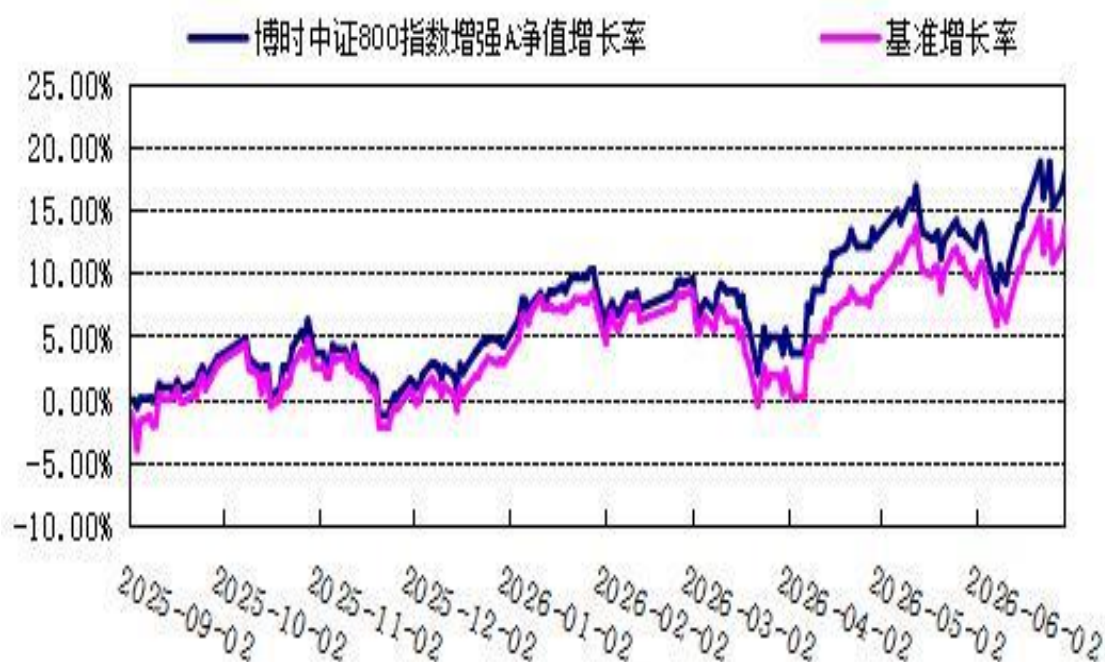
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时中证 800 指数增强型证券投资基金

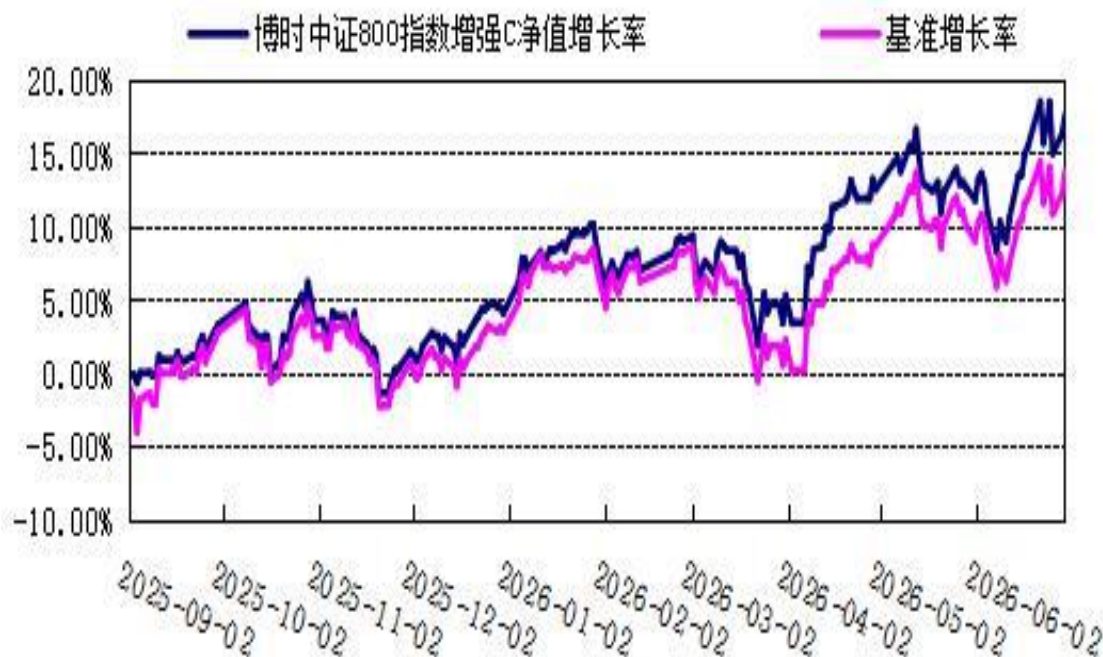
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2025 年 9 月 2 日至 2026 年 6 月 30 日)

博时中证 800 指数增强 A



博时中证 800 指数增强 C



注：本基金的基金合同于 2025 年 9 月 2 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	证券从业	说明
----	----	-------------	------	----

		理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
杨振建	基金经理	2025-09-02	-	12.8	杨振建先生，博士。2013 年至 2015 年在中证指数有限公司工作(期间借调中国证监会任产品审核员)。2015 年加入博时基金管理有限公司。历任研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理助理、博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日-2021 年 7 月 16 日)、博时中证 A500 指数型证券投资基金(2024 年 10 月 30 日-2024 年 11 月 28 日)、博时中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 5 月 14 日-2026 年 5 月 21 日)的基金经理。现任博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 9 月 20 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019 年 11 月 13 日—至今)、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2020 年 12 月 23 日—至今)、博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 3 月 3 日—至今)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 7 月 27 日—至今)、博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 11 月 2 日—至今)、博时中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 4 月 16 日—至今)、博时中证红利低波动 100 交

					易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 7 月 19 日—至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 11 月 21 日—至今)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2024 年 11 月 27 日—至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 11 月 29 日—至今)、博时中证 800 指数增强型证券投资基金(2025 年 9 月 2 日—至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2025 年 11 月 3 日—至今)的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

本报告期内，2026 年上半年 A 股市场呈现“震荡上行、结构分化”的态势，主要指数稳步收涨，市场活力显著增强，行情主线清晰，科技成长板块领涨，人工智能、算力半导体等新质生产力领域表现强劲，市场“含科量”显著提升，上证指数上半年收于 4094 点。海外在地缘局势逐步缓和之后，全球多数权益资产在年初波动后逐步回稳。本基金采用动态多因子模型对组合进行管理，因子配置均衡，对于风格约束和风险预算较为严格，力图在中证 800 指数基准基础上，获取相对稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1800 元，份额累计净值为 1.1800 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.1770 元，份额累计净值为 1.1770 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 13.10%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 12.93%，同期业绩基准增长率为 10.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。为确保基金估值工作符合以上规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、法律合规部负责人、风险管理部负责人、投资部门负责人、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的

工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具备良好专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会负责制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价，保证基金估值的公平、合理。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当对估值原则及技术存有异议时，本基金托管人有责任要求本基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内出现连续 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。针对该情形，本基金管理人已向中国证监会报告了解决方案。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对博时中证 800 指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对博时中证 800 指数增强型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现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

本报告期内，由博时基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时中证 800 指数增强型证券投资基金

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	791,736.63	8,422,988.33
结算备付金		975,786.71	3,537,656.02
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.6.2	25,752,503.51	86,155,423.46
其中：股票投资		25,752,503.51	85,447,720.78
基金投资		-	-
债券投资		-	707,702.68
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		-	-

应收股利		-	-
应收申购款		192,808.75	1,618.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	-	-
资产总计		27,712,835.60	98,117,686.38
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		-	-
应付赎回款		76,648.42	7,142,937.58
应付管理人报酬		19,155.07	71,345.36
应付托管费		2,394.37	8,918.19
应付销售服务费		3,510.24	10,537.10
应付投资顾问费		-	-
应交税费		16.18	1,137.18
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	58,945.06	25,000.00
负债合计		160,669.34	7,259,875.41
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	23,380,364.95	87,124,768.33
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	4,171,801.31	3,733,042.64
净资产合计		27,552,166.26	90,857,810.97
负债和净资产总计		27,712,835.60	98,117,686.38

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 23,380,364.95 份。其中 A 类基金份额净值 1.1800 元，基金份额总额 11,101,489.84 份；C 类基金份额净值 1.1770 元，基金份额总额 12,278,875.11 份。

6.2 利润表

会计主体：博时中证 800 指数增强型证券投资基金

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
一、营业总收入		6,559,266.99
1.利息收入		4,046.77
其中：存款利息收入	6.4.6.9	4,046.77
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）		6,224,301.56
其中：股票投资收益	6.4.6.10	5,907,174.21
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.6.11	964.36
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	316,162.99
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	6.4.6.15	330,237.39

列)		
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	681.27
减：二、营业总支出		241,640.20
1. 管理人报酬		159,783.87
其中：暂估管理人报酬（若有）		-
2. 托管费		19,973.01
3. 销售服务费		25,736.39
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		1.73
8. 其他费用	6.4.6.18	36,145.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,317,626.79
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,317,626.79
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		6,317,626.79

6.3 净资产变动表

会计主体：博时中证 800 指数增强型证券投资基金

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	87,124,768.33	-	3,733,042.64	90,857,810.97
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	87,124,768.33	-	3,733,042.64	90,857,810.97
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-63,744,403.38	-	438,758.67	-63,305,644.71
(一)、综合收益总额	-	-	6,317,626.79	6,317,626.79
(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)	-63,744,403.38	-	-5,878,868.12	-69,623,271.50
其中：1.基金申购款	11,371,471.15	-	1,122,990.26	12,494,461.41
2.基金赎回款	-75,115,874.53	-	-7,001,858.38	-82,117,732.91
(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	23,380,364.95	-	4,171,801.31	27,552,166.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张东，主管会计工作负责人：吴慧峰，会计机构负责人：陈子成

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博时中证 800 指数增强型证券投资基金(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[2025]299 号《关于准予博时中证 800 指数增强型证券投资基金注册的批复》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《博时中证 800 指数增强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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 208,557,643.34 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_A22 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博时中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 9 月 2 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 208,627,364.88 份基金份额,其中认购资金利息折合 69,721.54 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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《博时中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》,本基金根据认购/申购费用与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、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《博时中证 800 指数增强型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,本基金可能会部分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、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债)、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)、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权、债券回购、货币市场工具(包括银行存款、同业存单等)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及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例不低于 80%,其中投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%;投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%;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,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、

存出保证金和应收申购款等；股指期货、股票期权、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 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。

（5） 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	791,736.63
等于：本金	791,648.04
加：应计利息	88.59
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	791,736.63

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		23,030,026.34	-	25,752,503.51	2,722,477.17
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		23,030,026.34	-	25,752,503.51	2,722,477.17

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

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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	58,945.06
合计	58,945.06

6.4.6.7 实收基金

博时中证 800 指数增强 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	51,874,646.80	51,874,646.80

本期申购	1,273,244.70	1,273,244.70
本期赎回（以“-”号填列）	-42,046,401.66	-42,046,401.66
本期末	11,101,489.84	11,101,489.84

博时中证 800 指数增强 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	35,250,121.53	35,250,121.53
本期申购	10,098,226.45	10,098,226.45
本期赎回（以“-”号填列）	-33,069,472.87	-33,069,472.87
本期末	12,278,875.11	12,278,875.11

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
博时中证 800 指数增强 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	1,932,018.54	312,892.28	2,244,910.82
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	1,932,018.54	312,892.28	2,244,910.82
本期利润	3,606,066.54	67,001.04	3,673,067.58
本期基金份额交易产生的变动数	-3,564,074.39	-355,833.39	-3,919,907.78
其中：基金申购款	147,088.39	-29,019.22	118,069.17
基金赎回款	-3,711,162.78	-326,814.17	-4,037,976.95
本期已分配利润	-	-	-

本期末	1,974,010.69	24,059.93	1,998,070.62
-----	--------------	-----------	--------------

博时中证 800 指数增强 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	1,275,566.83	212,564.99	1,488,131.82
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	1,275,566.83	212,564.99	1,488,131.82
本期利润	2,381,322.86	263,236.35	2,644,559.21
本期基金份额交易产生的变动数	-1,509,334.08	-449,626.26	-1,958,960.34
其中：基金申购款	1,181,016.67	-176,095.58	1,004,921.09
基金赎回款	-2,690,350.75	-273,530.68	-2,963,881.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,147,555.61	26,175.08	2,173,730.69

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	3,377.59
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	669.18
其他	-
合计	4,046.77

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	121,431,249.80
减：卖出股票成本总额	115,418,093.58
减：交易费用	105,982.01
买卖股票差价收入	5,907,174.21

6.4.6.11 债券投资收益

6.4.6.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,136.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-172.21
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	964.36

6.4.6.11.2 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	1,709,879.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,699,692.00
减：应计利息总额	10,159.59
减：交易费用	200.21

买卖债券差价收入	-172.21
----------	---------

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	316,162.99
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	316,162.99

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	330,237.39
——股票投资	329,903.39
——债券投资	334.00
——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	330,237.39

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	676.81
基金转换费收入	4.46
合计	681.27

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	8,081.82
信息披露费	25,863.24
证券出借违约金	-
其他	11.84
银行汇划费	2,188.30
合计	36,145.20

注：自 2026 年 4 月 29 日至 2026 年 6 月 30 日，基金管理人自主承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用。

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方、关联关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	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

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	176,824,222.72	100.00%

6.4.9.1.2 权证交易

无。

6.4.9.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
-------	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	1,999,048.00	100.00%

6.4.9.1.4 债券回购交易

无。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	34,125.93	100.00%	-	-

注：1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	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	159,783.87
其中：应支付销售机构的客户维护费	77,118.43
应支付基金管理人的净管理费	82,665.44

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 0.80%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×0.80%/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	19,973.01

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.9.2.3 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		
	博时中证 800 指数 增强 A	博时中证 800 指数增强 C	合计
招商证券	-	0.14	0.14
浦发银行	-	23,777.97	23,777.97
博时基金	-	262.60	262.60
合计	-	24,040.71	24,040.71

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

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

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	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
浦发银行-活期存款	791,736.63	3,377.59

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

无。

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10 利润分配情况

无。

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

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

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
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	200.00	133,998.00	166,400.00	-

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。本基金为股票型指数增强基金，跟踪中证 800 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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过数量化方法进行组合管理和风险控制，在力求对标的指数中证 800 指数有效跟踪的

基础上，力争实现超越基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.50%，年跟踪误差不超过 7.5%。

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	-	707,702.68
合计	-	707,702.68

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

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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

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	791,736.63	-	-	-	791,736.63
结算备付金	975,786.71	-	-	-	975,786.71
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	25,752,503.51	25,752,503.51
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	192,808.75	192,808.75
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,767,523.34	-	-	25,945,312.26	27,712,835.60
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	76,648.42	76,648.42
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	19,155.07	19,155.07
应付托管费	-	-	-	2,394.37	2,394.37
应付销售服务费	-	-	-	3,510.24	3,510.24
应交税费	-	-	-	16.18	16.18
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	58,945.06	58,945.06
负债总计	-	-	-	160,669.34	160,669.34

利率敏感度缺口	1,767,523.34	-	-	25,784,642.92	27,552,166.26
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	8,422,988.33	-	-	-	8,422,988.33
结算备付金	3,537,656.02	-	-	-	3,537,656.02
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	707,702.68	-	-	85,447,720.78	86,155,423.46
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资 产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,618.57	1,618.57
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,668,347.03	-	-	85,449,339.35	98,117,686.38
负债					
卖出回购金融资 产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	7,142,937.58	7,142,937.58
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	71,345.36	71,345.36
应付托管费	-	-	-	8,918.19	8,918.19
应付销售服务费	-	-	-	10,537.10	10,537.10
应交税费	-	-	-	1,137.18	1,137.18
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	25,000.00	25,000.00
负债总计	-	-	-	7,259,875.41	7,259,875.41
利率敏感度缺口	12,668,347.03	-	-	78,189,463.94	90,857,810.97

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

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 0
	市场利率下降 25 个基点	-	增加约 0

注：1.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。

2. 以上金额为四舍五入的结果。

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	25,752,503.51	93.47	85,447,720.78	94.05
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	25,752,503.51	93.47	85,447,720.78	94.05

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 143	增加约 480
	业绩比较基准下降 5%	减少约 143	减少约 480

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	25,586,103.51
第二层次	166,400.00
第三层次	-
合计	25,752,503.51

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	25,752,503.51	92.93
	其中：股票	25,752,503.51	92.93
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	1,767,523.34	6.38
8	其他各项资产	192,808.75	0.70

9	合计	27,712,835.60	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	89,972.00	0.33
B	采矿业	947,690.00	3.44
C	制造业	14,531,535.60	52.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	329,238.00	1.19
E	建筑业	44,835.00	0.16
F	批发和零售业	527,319.00	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	164,494.00	0.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,288,112.95	4.68
J	金融业	3,421,628.00	12.42
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	160,564.00	0.58
M	科学研究和技术服务业	348,628.00	1.27
N	水利、环境和公共设施管理业	13,662.00	0.05
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	21,867,678.55	79.37

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	55,531.00	0.20
B	采矿业	19,776.00	0.07
C	制造业	2,344,965.56	8.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,614.00	0.11
E	建筑业	116,120.00	0.42
F	批发和零售业	303,564.00	1.10
G	交通运输、仓储和邮政业	95,288.00	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	94,638.00	0.34
J	金融业	37,202.00	0.14
K	房地产业	333,252.40	1.21
L	租赁和商务服务业	66,124.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	74,400.00	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	270,022.00	0.98
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	43,328.00	0.16
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,884,824.96	14.10

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	300308	中际旭创	800	1,016,000.00	3.69
2	300750	宁德时代	2,100	825,321.00	3.00
3	300502	新易盛	1,020	619,140.00	2.25
4	603986	兆易创新	600	489,000.00	1.77
5	600519	贵州茅台	400	474,196.00	1.72
6	600030	中信证券	13,700	393,601.00	1.43
7	603259	药明康德	2,800	348,628.00	1.27
8	000333	美的集团	4,600	347,438.00	1.26
9	601899	紫金矿业	13,300	334,362.00	1.21
10	601138	工业富联	4,200	303,030.00	1.10
11	600150	中国船舶	8,800	297,352.00	1.08
12	002384	东山精密	1,000	262,350.00	0.95
13	002415	海康威视	7,600	259,920.00	0.94
14	000776	广发证券	11,000	257,400.00	0.93
15	600900	长江电力	9,600	254,112.00	0.92
16	000938	紫光股份	8,700	251,082.00	0.91
17	601318	中国平安	5,200	248,248.00	0.90
18	600887	伊利股份	10,300	246,788.00	0.90
19	688256	寒武纪	149	237,736.95	0.86
20	688012	中微公司	498	233,313.00	0.85
21	601995	中金公司	6,400	231,360.00	0.84
22	600015	华夏银行	35,200	224,928.00	0.82
23	000792	盐湖股份	7,300	220,387.00	0.80
24	688008	澜起科技	700	216,930.00	0.79
25	002414	高德红外	16,300	216,138.00	0.78
26	688111	金山办公	1,000	213,050.00	0.77
27	301308	江波龙	300	211,140.00	0.77
28	600919	江苏银行	19,100	205,898.00	0.75
29	002475	立讯精密	2,900	204,160.00	0.74
30	688002	睿创微纳	1,300	201,097.00	0.73
31	601688	华泰证券	9,700	200,014.00	0.73
32	002463	沪电股份	1,300	198,640.00	0.72
33	601398	工商银行	27,700	195,839.00	0.71
34	600183	生益科技	1,100	190,740.00	0.69
35	001309	德明利	200	188,580.00	0.68
36	000538	云南白药	3,900	184,743.00	0.67
37	300475	香农芯创	600	180,000.00	0.65
38	601066	中信建投	6,100	177,327.00	0.64
39	300604	长川科技	500	170,710.00	0.62
40	300408	三环集团	1,000	166,900.00	0.61

41	600036	招商银行	4,700	166,850.00	0.61
42	688041	海光信息	450	166,635.00	0.60
43	688072	拓荆科技	200	166,400.00	0.60
44	300857	协创数据	480	163,152.00	0.59
45	600019	宝钢股份	29,900	162,357.00	0.59
46	601108	财通证券	18,300	158,295.00	0.57
47	002027	分众传媒	30,900	149,556.00	0.54
48	688521	芯原股份	400	148,456.00	0.54
49	601328	交通银行	22,400	144,032.00	0.52
50	600309	万华化学	2,100	143,661.00	0.52
51	603444	吉比特	400	143,368.00	0.52
52	300394	天孚通信	460	139,232.80	0.51
53	002271	东方雨虹	11,700	138,879.00	0.50
54	300476	胜宏科技	400	138,572.00	0.50
55	000895	双汇发展	6,100	136,640.00	0.50
56	002142	宁波银行	4,600	136,574.00	0.50
57	601857	中国石油	15,400	133,672.00	0.49
58	603993	洛阳钼业	7,600	133,380.00	0.48
59	002558	巨人网络	4,800	132,288.00	0.48
60	000408	藏格矿业	1,900	131,708.00	0.48
61	600176	中国巨石	1,800	131,184.00	0.48
62	601360	三六零	15,000	130,350.00	0.47
63	688981	中芯国际	800	127,056.00	0.46
64	300223	北京君正	500	124,450.00	0.45
65	000001	平安银行	12,300	123,615.00	0.45
66	601288	农业银行	20,300	123,221.00	0.45
67	605117	德业股份	1,160	123,168.80	0.45
68	000951	中国重汽	6,200	120,962.00	0.44
69	000338	潍柴动力	4,400	119,900.00	0.44
70	601877	正泰电器	4,600	115,322.00	0.42
71	002299	圣农发展	7,500	113,700.00	0.41
72	000988	华工科技	600	110,766.00	0.40
73	600522	中天科技	1,800	109,224.00	0.40
74	000725	京东方 A	12,500	108,500.00	0.39
75	002709	天赐材料	2,100	108,003.00	0.39
76	000708	中信特钢	8,500	107,270.00	0.39
77	002517	恺英网络	6,500	105,625.00	0.38
78	002008	大族激光	700	105,077.00	0.38
79	000651	格力电器	2,800	105,000.00	0.38
80	601166	兴业银行	6,300	104,328.00	0.38
81	300014	亿纬锂能	1,600	104,048.00	0.38
82	600938	中国海油	3,800	103,170.00	0.37
83	600741	华域汽车	6,300	97,776.00	0.35

84	600998	九州通	19,900	93,331.00	0.34
85	002916	深南电路	200	91,580.00	0.33
85	300033	同花顺	380	91,580.00	0.33
86	301358	湖南裕能	1,200	91,044.00	0.33
87	600598	北大荒	8,300	89,972.00	0.33
88	000807	云铝股份	4,000	88,560.00	0.32
89	002371	北方华创	100	88,456.00	0.32
90	300073	当升科技	1,800	86,472.00	0.31
91	000657	中钨高新	900	86,148.00	0.31
92	603019	中科曙光	800	85,784.00	0.31
93	601607	上海医药	5,500	84,700.00	0.31
94	600989	宝丰能源	4,000	81,320.00	0.30
95	603233	大参林	5,300	79,659.00	0.29
96	600801	华新建材	5,000	78,000.00	0.28
97	688578	艾力斯	700	76,440.00	0.28
98	300037	新宙邦	800	74,280.00	0.27
99	002001	新和成	2,600	73,892.00	0.27
100	601766	中国中车	14,200	73,840.00	0.27
101	002236	大华股份	4,400	72,556.00	0.26
102	002460	赣锋锂业	1,100	71,940.00	0.26
103	001389	广合科技	300	71,175.00	0.26
104	688297	中无人机	1,700	70,635.00	0.26
105	688266	泽璟制药	600	69,996.00	0.25
106	002028	思源电气	400	69,200.00	0.25
107	001286	陕西能源	6,700	67,938.00	0.25
108	688347	华虹宏力	200	67,260.00	0.24
109	601088	中国神华	1,700	66,368.00	0.24
110	002602	世纪华通	4,700	66,270.00	0.24
111	600685	中船防务	2,600	66,144.00	0.24
112	601872	招商轮船	3,700	65,009.00	0.24
113	600927	永安期货	5,200	64,740.00	0.23
114	301536	星辰科技	500	64,355.00	0.23
115	603345	安井食品	800	64,152.00	0.23
116	002487	大金重工	1,100	63,767.00	0.23
117	300136	信维通信	500	59,625.00	0.22
118	600489	中金黄金	3,300	59,565.00	0.22
119	000783	长江证券	6,100	59,475.00	0.22
120	600233	圆通速递	3,700	58,275.00	0.21
121	002230	科大讯飞	1,400	57,176.00	0.21
122	002648	卫星化学	2,400	56,376.00	0.20
123	688629	华丰科技	300	56,253.00	0.20
124	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.20
125	002202	金风科技	2,300	54,970.00	0.20

126	601225	陕西煤业	2,700	54,945.00	0.20
127	300395	菲利华	400	53,492.00	0.19
128	300972	万辰集团	300	52,023.00	0.19
129	002281	光迅科技	200	51,388.00	0.19
130	600549	厦门钨业	600	51,120.00	0.19
131	300432	富临精工	2,400	48,216.00	0.17
132	300274	阳光电源	300	47,706.00	0.17
133	300390	天华新能	500	46,755.00	0.17
134	002353	杰瑞股份	300	45,750.00	0.17
135	601117	中国化学	6,100	44,835.00	0.16
136	300919	中伟新材	1,000	43,750.00	0.16
137	300953	震裕科技	300	40,110.00	0.15
138	688778	厦钨新能	700	38,080.00	0.14
139	600372	中航机载	3,500	37,975.00	0.14
140	300620	光库科技	100	37,820.00	0.14
141	300666	江丰电子	100	36,860.00	0.13
142	301200	大族数控	100	36,065.00	0.13
143	000062	深圳华强	1,100	35,002.00	0.13
144	300442	润泽科技	400	33,228.00	0.12
145	601939	建设银行	3,400	32,742.00	0.12
146	601156	东航物流	2,000	32,240.00	0.12
147	600601	方正科技	2,300	31,832.00	0.12
148	601009	南京银行	3,200	31,648.00	0.11
149	600584	长电科技	300	31,065.00	0.11
150	600546	山煤国际	2,800	30,604.00	0.11
151	300458	全志科技	700	27,622.00	0.10
152	000519	中兵红箭	1,300	27,391.00	0.10
153	603256	宏和科技	100	26,533.00	0.10
154	000630	铜陵有色	3,600	22,896.00	0.08
155	600089	特变电工	1,000	22,500.00	0.08
156	600028	中国石化	4,700	20,962.00	0.08
157	600406	国电南瑞	900	20,565.00	0.07
158	600105	永鼎股份	300	20,244.00	0.07
159	002466	天齐锂业	300	18,396.00	0.07
160	300059	东方财富	900	18,342.00	0.07
161	000423	东阿阿胶	400	18,144.00	0.07
162	300373	扬杰科技	100	15,723.00	0.06
163	000800	一汽解放	2,600	15,470.00	0.06
164	600332	白云山	700	14,028.00	0.05
165	002266	浙富控股	2,700	13,662.00	0.05
166	688183	生益电子	100	13,240.00	0.05
167	300735	光弘科技	500	11,370.00	0.04
168	300058	蓝色光标	800	11,008.00	0.04

169	601988	中国银行	1,900	10,868.00	0.04
170	600295	鄂尔多斯	1,000	10,720.00	0.04
171	600188	兖矿能源	600	10,662.00	0.04
172	300054	鼎龙股份	100	10,597.00	0.04
173	601600	中国铝业	1,200	9,864.00	0.04
174	600026	中远海能	500	8,970.00	0.03
175	601233	桐昆股份	400	8,660.00	0.03
176	601788	光大证券	600	8,658.00	0.03
177	600316	洪都航空	300	8,382.00	0.03
178	601998	中信银行	1,100	7,623.00	0.03
179	000155	川能动力	600	7,188.00	0.03
180	600499	科达制造	500	6,900.00	0.03
181	301606	绿联科技	100	6,102.00	0.02
182	600460	士兰微	100	5,466.00	0.02
183	603799	华友钴业	100	4,826.00	0.02
184	600369	西南证券	1,100	4,422.00	0.02
185	300450	先导智能	100	4,072.00	0.01
186	600511	国药股份	100	2,604.00	0.01
187	000703	恒逸石化	100	1,357.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	688766	普冉股份	200.00	153,320.00	0.56
2	600323	瀚蓝环境	5,500.00	151,030.00	0.55
3	300590	移为通信	10,100.00	144,935.00	0.53
4	000933	神火股份	5,400.00	114,480.00	0.42
5	002111	威海广泰	12,000.00	108,000.00	0.39
6	688525	佰维存储	200.00	98,946.00	0.36
7	603317	天味食品	7,600.00	98,876.00	0.36
8	600007	中国国贸	5,000.00	94,900.00	0.34
9	002653	海思科	1,400.00	92,876.00	0.34
10	601061	中信金属	7,600.00	81,852.00	0.30
11	688503	聚和材料	600.00	79,620.00	0.29
12	300681	英搏尔	2,700.00	77,274.00	0.28
13	600428	中远海特	9,800.00	76,538.00	0.28
14	688372	伟测科技	400.00	74,400.00	0.27
15	600502	安徽建工	16,900.00	73,515.00	0.27
16	301345	涛涛车业	300.00	69,300.00	0.25
17	688127	蓝特光学	700.00	68,320.00	0.25
18	600064	南京高科	9,380.00	66,879.40	0.24

19	002557	洽洽食品	3,700.00	66,452.00	0.24
20	300438	鹏辉能源	800.00	66,280.00	0.24
21	600755	厦门国贸	12,200.00	66,124.00	0.24
22	688155	先惠技术	800.00	64,712.00	0.23
23	603588	高能环境	3,100.00	59,520.00	0.22
24	002033	丽江股份	7,200.00	59,472.00	0.22
25	000778	新兴铸管	15,600.00	57,876.00	0.21
26	688630	芯碁微装	100.00	54,939.00	0.20
27	605599	菜百股份	4,000.00	54,800.00	0.20
28	001914	招商积余	6,700.00	54,672.00	0.20
29	600487	亨通光电	500.00	54,670.00	0.20
30	002416	爱施德	6,100.00	54,656.00	0.20
31	002043	兔宝宝	4,900.00	54,292.00	0.20
32	301607	富特科技	1,020.00	53,295.00	0.19
33	603061	金海通	100.00	50,222.00	0.18
34	688388	嘉元科技	1,105.00	48,620.00	0.18
35	688045	必易微	600.00	48,468.00	0.18
36	003010	若羽臣	1,900.00	46,170.00	0.17
37	300042	朗科科技	600.00	45,702.00	0.17
38	000036	华联控股	10,300.00	45,011.00	0.16
39	001287	中电港	1,400.00	43,610.00	0.16
40	605098	行动教育	800.00	43,328.00	0.16
41	301087	可孚医疗	900.00	42,885.00	0.16
42	688110	东芯股份	200.00	40,740.00	0.15
43	688059	华锐精密	200.00	39,942.00	0.14
44	002458	益生股份	5,100.00	39,627.00	0.14
45	002091	江苏国泰	5,200.00	37,596.00	0.14
46	002961	瑞达期货	1,900.00	37,202.00	0.14
47	688416	恒烁股份	260.00	36,400.00	0.13
48	688308	欧科亿	200.00	36,362.00	0.13
49	600641	先导基电	900.00	35,874.00	0.13
50	688779	五矿新能	4,000.00	32,440.00	0.12
51	300975	商络电子	600.00	31,050.00	0.11
52	688257	新锐股份	280.00	28,532.00	0.10
53	601886	江河集团	3,500.00	28,105.00	0.10
54	300769	德方纳米	400.00	26,600.00	0.10
55	600266	城建发展	6,800.00	26,588.00	0.10
56	603638	艾迪精密	1,100.00	25,795.00	0.09
57	688275	万润新能	200.00	25,510.00	0.09
58	301031	中熔电气	200.00	23,890.00	0.09
59	688221	前沿生物	1,000.00	22,400.00	0.08
60	001218	丽臣实业	1,000.00	22,060.00	0.08
61	000685	中山公用	1,900.00	21,204.00	0.08

62	688321	微芯生物	800.00	21,064.00	0.08
63	001339	智微智能	200.00	20,456.00	0.07
64	000426	兴业银锡	600.00	19,776.00	0.07
65	688530	欧莱新材	200.00	19,380.00	0.07
66	002151	北斗星通	600.00	19,050.00	0.07
67	688208	道通科技	724.00	18,237.56	0.07
68	002701	奥瑞金	4,200.00	17,892.00	0.06
69	000973	佛塑科技	1,200.00	17,220.00	0.06
70	688559	海目星	200.00	16,784.00	0.06
71	600787	中储股份	3,900.00	16,302.00	0.06
72	002772	众兴菌业	1,400.00	15,904.00	0.06
73	605289	罗曼股份	100.00	14,500.00	0.05
74	603268	松发股份	100.00	13,928.00	0.05
75	002378	章源钨业	400.00	13,392.00	0.05
76	300397	天和防务	700.00	10,598.00	0.04
77	002039	黔源电力	500.00	9,410.00	0.03
78	000031	大悦城	4,400.00	9,328.00	0.03
79	300323	华灿光电	400.00	8,160.00	0.03
80	603045	福达合金	100.00	7,139.00	0.03
81	600251	冠农股份	800.00	6,912.00	0.03
82	688239	航宇科技	100.00	5,983.00	0.02
83	000886	海南高速	600.00	2,448.00	0.01
84	600750	华润江中	100.00	2,207.00	0.01

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	600036	招商银行	959,064.00	1.06
2	600030	中信证券	924,412.00	1.02
3	600741	华域汽车	597,167.00	0.66
4	000776	广发证券	538,872.00	0.59
5	688111	金山办公	526,588.42	0.58
6	600015	华夏银行	507,781.00	0.56
7	600276	恒瑞医药	503,819.00	0.55
8	000001	平安银行	482,843.00	0.53
9	601318	中国平安	463,729.00	0.51
10	688498	源杰科技	460,826.00	0.51
11	688012	中微公司	423,230.78	0.47
12	000100	TCL 科技	399,206.00	0.44

13	600104	上汽集团	397,970.00	0.44
14	000338	潍柴动力	392,517.00	0.43
15	603927	中科软	391,171.00	0.43
16	000333	美的集团	385,687.00	0.42
17	000792	盐湖股份	373,299.00	0.41
18	600795	国电电力	372,703.00	0.41
19	603259	药明康德	365,893.00	0.40
20	600339	中油工程	357,921.00	0.39

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	300750	宁德时代	2,408,083.00	2.65
2	300308	中际旭创	2,062,825.00	2.27
3	601899	紫金矿业	1,650,896.00	1.82
4	600036	招商银行	1,576,171.00	1.73
5	601166	兴业银行	1,369,286.00	1.51
6	000333	美的集团	1,353,115.37	1.49
7	688256	寒武纪	1,314,214.00	1.45
8	300502	新易盛	1,311,367.00	1.44
9	603259	药明康德	1,183,620.00	1.30
10	600150	中国船舶	1,133,333.31	1.25
11	300442	润泽科技	1,108,515.00	1.22
12	601318	中国平安	1,097,651.00	1.21
13	601138	工业富联	1,095,498.00	1.21
14	600406	国电南瑞	1,054,954.00	1.16
15	601857	中国石油	1,034,851.00	1.14
16	001337	四川黄金	1,021,089.00	1.12
17	600989	宝丰能源	1,006,536.00	1.11
18	600519	贵州茅台	989,784.00	1.09
19	002475	立讯精密	987,474.00	1.09
20	300033	同花顺	981,268.40	1.08

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	55,392,972.92
卖出股票的收入（成交）总额	121,431,249.80

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	192,808.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	192,808.75

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	持有份额	占总份

				额比例		额比例
博时中证 800 指数增强 A	219	50,691.73	-	-	11,101,489.84	100.00%
博时中证 800 指数增强 C	403	30,468.67	-	-	12,278,875.11	100.00%
合计	607	38,517.90	-	-	23,380,364.95	100.00%

8.2 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	博时中证 800 指数增强 A	48,954.92	0.44%
	博时中证 800 指数增强 C	-	-
	合计	48,954.92	0.21%

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时中证 800 指数增强 A	-
	博时中证 800 指数增强 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时中证 800 指数增强 A	0~10
	博时中证 800 指数增强 C	-
	合计	0~10

注：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。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时中证 800 指数增强 A	博时中证 800 指数增强 C
----	-----------------	-----------------

基金合同生效日(2025 年 9 月 2 日)		
基金份额总额	117,371,750.60	91,255,614.28
本报告期期初基金份额总额	51,874,646.80	35,250,121.53
本报告期基金总申购份额	1,273,244.70	10,098,226.45
减：本报告期基金总赎回份额	42,046,401.66	33,069,472.87
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	11,101,489.84	12,278,875.11

§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。

报告期内，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。

报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

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。

10.6 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

报告期内，托管人无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

报告期内，托管人相关从业人员无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	
招商证券	3	176,824,222.72	100.00%	34,125.93	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
招商证券	1,999,048.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时中证 800 指数增强型证券投资基金（博时中证 800 指数增强 A）基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-26
2	博时中证 800 指数增强型证券投资基金（博时中证 800 指数增强 C）基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-26
3	博时中证 800 指数增强型证券投资基金更新招募说明书	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-05-30
4	博时基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-05-29
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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-30
6	博时中证 800 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-22
7	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）	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31
8	博时中证 800 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	证券时报、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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-26
10	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-14
11	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长	证券时报、基金管理人网	2026-01-24

	期停牌股票调整估值方法的公告-20260124	站、证监会基金电子披露网站	
12	博时中证 800 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	证券时报、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中证 800 指数增强型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时中证 800 指数增强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、博时中证 800 指数增强型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时中证 800 指数增强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