

博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：渣打银行（中国）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。

基金托管人渣打银行（中国）有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
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	13
§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	20
§7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	65
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	66
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	66
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	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66

7.12 投资组合报告附注	66
§8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 盈利投资者数量占比	68
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	68
§9 开放式基金份额变动	69
§10 重大事件揭示	69
10.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	70
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	70
10.8 其他重大事件	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金	
基金简称	博时 ESG 量化选股混合	
基金主代码	018130	
交易代码	018130	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 31 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	渣打银行（中国）有限公司	
报告期末基金份额总额	422,681,426.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时 ESG 量化选股混合 A	博时 ESG 量化选股混合 C
下属分级基金的交易代码	018130	018131
报告期末下属分级基金的份额总额	300,017,978.25 份	122,663,447.80 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化模型精选 ESG 主题证券，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资策略分为大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、流通受限证券投资策略及参与融资业务的投资策略。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，股票投资策略在 ESG 主题的框架下以“量化投资”为主要投资策略，通过量化模型进行股票选择并构建股票投资组合。
业绩比较基准	中证 800ESG 基准指数收益率*75%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+中债综合财富（总值）指数收益率*20%

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。
--------	---

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	渣打银行（中国）有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	季琴琴
	联系电话	0755-83169999	021-50163207
	电子邮箱	service@bosera.com	Operation.CN_LFC@sc.com
客户服务电话		95105568	8009990213
传真		0755-83195140	021-38963013
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	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 201 号渣打银行大厦 16 层、17 层、18 层 1、3、4 室、19 层 3、4 室、22 层 1、2、4 室、23 层 1、2 室、25 层 1、3、4 室及 28 层
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 201 号渣打银行大厦 16 层、17 层、18 层 1、3、4 室、19 层 3、4 室、22 层 1、2、4 室、23 层 1、2 室、25 层 1、3、4 室及 28 层
邮政编码		518040	200120
法定代表人		张东	鲁静

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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 ESG 量化选股混合 A	博时 ESG 量化选股混合 C
本期已实现收益	17,295,010.72	7,036,379.14
本期利润	-5,462,437.49	-5,745,894.83
加权平均基金份额本期利润	-0.0124	-0.0321
本期加权平均净值利润率	-0.79%	-2.08%
本期基金份额净值增长率	-1.94%	-2.38%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	博时 ESG 量化选股混合 A	博时 ESG 量化选股混合 C
期末可供分配利润	134,994,708.14	51,586,757.96
期末可供分配基金份额利润	0.4500	0.4206
期末基金资产净值	457,585,857.36	183,296,071.15
期末基金份额净值	1.5252	1.4943
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	博时 ESG 量化选股混合 A	博时 ESG 量化选股混合 C
基金份额累计净值增长率	52.52%	49.43%

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 ESG 量化选股混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	12.74%	2.00%	9.78%	0.98%	2.96%	1.02%
过去六个月	-1.94%	1.87%	7.54%	0.92%	-9.48%	0.95%
过去一年	13.42%	1.61%	22.58%	0.82%	-9.16%	0.79%
过去三年	57.56%	1.44%	28.34%	0.90%	29.22%	0.54%
自基金合同生效起至今	52.52%	1.40%	24.18%	0.88%	28.34%	0.52%

博时 ESG 量化选股混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	12.57%	2.00%	9.78%	0.98%	2.79%	1.02%
过去六个月	-2.38%	1.86%	7.54%	0.92%	-9.92%	0.94%
过去一年	12.56%	1.61%	22.58%	0.82%	-10.02%	0.79%
过去三年	54.61%	1.44%	28.34%	0.90%	26.27%	0.54%
自基金合同生效起至今	49.43%	1.40%	24.18%	0.88%	25.25%	0.52%

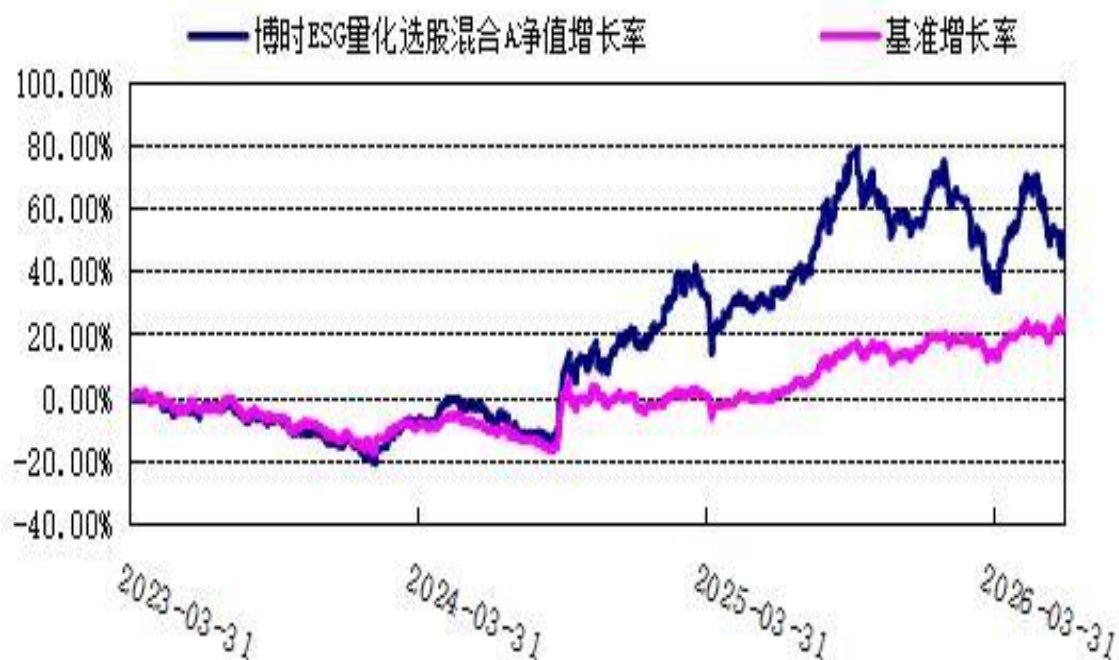
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金

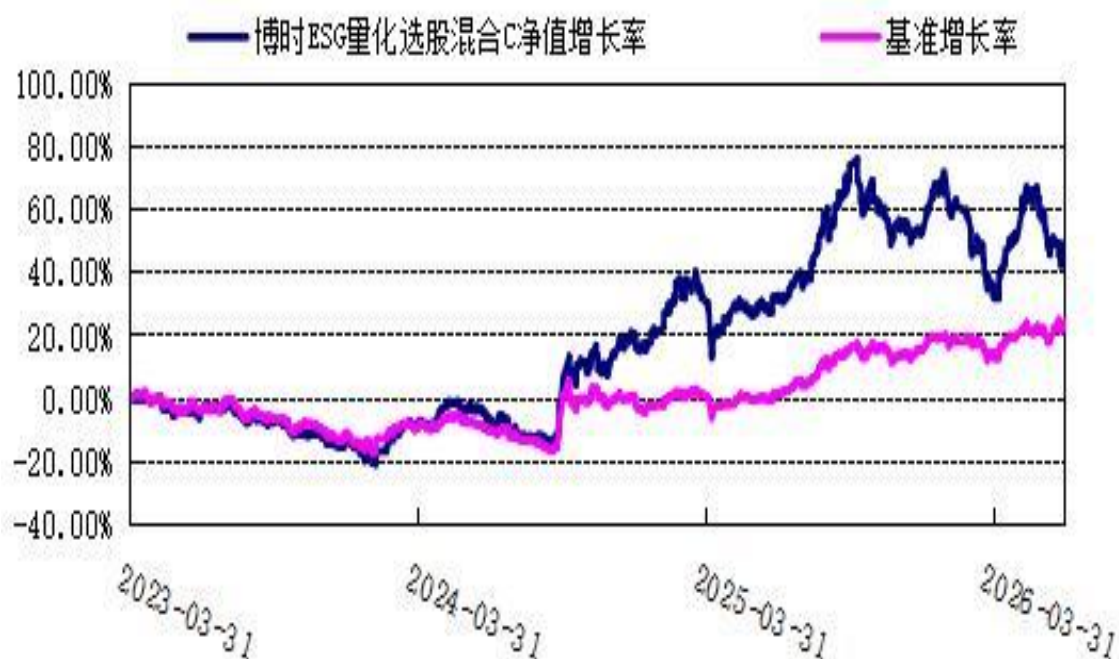
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2023 年 3 月 31 日至 2026 年 6 月 30 日）

博时 ESG 量化选股混合 A



博时 ESG 量化选股混合 C



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2026 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 404 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 17,353 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,993 亿元人民币，累计分红逾 2,312 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘钊	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2023-03-31	-	19.8	刘钊先生，博士。2006 年起先后在深圳证券交易所、五矿证券、摩根士丹利华鑫基金、深圳知方石投资有限公司工作。2020 年加入博时基金管理有限公司。曾任博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日-2024 年 7 月 10 日)基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2020 年 12 月 23 日—至今)、博时智选量化多因子股票型证券投资基金(2021 年 11 月 2 日—至今)、博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 2 月 13 日—至今)、博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金(2023 年 3 月 31 日—至今)、博时稳合一年持有期混合型证券投资基金(2024 年 4 月 17 日—至今)的基金经理。
邓灼	基金经理助理	2023-03-31	-	12.8	邓灼女士，博士。2013 年至

					2020 年先后在香港科技大学、凯谛思设计及工程有限公司、信永中和（香港）会计师事务所工作。2020 年 6 月加入博时基金管理有限公司。现任基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 18 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，海内外权益市场整体呈现先抑后扬、极致结构化分化特征。

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

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

产业方面，大 AI 产业链较为突出。一季度开源 AI 智能体框架“龙虾”（OpenClaw）快速普及，低门槛、开源开放的特性打破行业发展壁垒，带动算力、存储等 AI 硬件需求大幅扩容，AI 全产业链景气度全面激活，为科技板块提供持续结构性机会。二季度 AI 产业景气度进一步向高端赛道集中，结构性分化加剧。但随着 HBM 高端存储需求爆发，头部晶圆厂优先保障算力订单、压降成熟制程产能，挤压手机、PC 等消费电子芯片供给。上游零部件涨价推升终端成本，叠加居民消费意愿偏弱，消费电子及下游传统行业需求持续走弱，形成 AI 算力上游高景气、终端消费偏弱的割裂格局。

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

整个上半年，本基金持续暴露成长因子与新质生产力行业因子，紧扣产业升级与经济转型主线，超配科创、高端制造等高景气赛道。个股层面，我们延续了基于量化模型的主动优化策略，提升了个股风险敞口，集中配置了具备核心技术壁垒与龙头优势的优质标的，强化持仓核心竞争力。

但在二季度尾端，基于收缩风险的考量，我们对持仓进行了部分的调整，适度平衡了成长行业暴露，增配了消费等跟科技关联性弱的行业，收缩偏高的风险敞口，兼顾了收益弹性与组合稳健性。

港股市场，我们仍然维持了相对积极的风险偏好，使用量化模型结合主观判断，对相关个股进行了重点配置。我们认为，港股的战略价值可能在未来的几个季度逐步显现。

本基金坚持在公司 ESG 股票池划定的范围内选股，恪守将环境保护、社会责任和公司治理纳入投资决策的投资理念。

整个上半年，我们坚持了量化与主观研判结合的投研体系，贴合产业趋势动态微调持仓，长期

投资思路清晰连贯。

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 1.5252 元，份额累计净值为 1.5252 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.4943 元，份额累计净值为 1.4943 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-1.94%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-2.38%，同期业绩基准增长率为 7.54%。

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，中东地缘扰动仍可能阶段性存在，但短期脉冲影响将逐步消退，油价有望向合理区间回归，全球风险偏好持续修复。国内稳增长政策持续落地，经济复苏态势稳步巩固，经济转型与新质生产力发展的长期逻辑不变，A 股结构性行情延续，科技与高端制造赛道仍具备突出配置价值。

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

策略层面，本基金下半年将延续核心配置框架，不对核心因子做大幅调整，持续深耕高景气核心赛道。同时精细化管控组合风险，根据市场与产业变化动态微调风险敞口、优化持仓结构。后续将持续超配 AI 全产业链、高端制造等优质赛道，依托量化数据与主观深度研判挖掘优质成长标的，优化收益结构，力争跑赢业绩基准与同业水平，为持有人创造长期稳健回报。

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，本基金托管人在对博时 ESG 量化选股混合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、基金合同和托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本基金托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人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、利润分配等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对本报告中财务指标、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，认为其真实、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 ESG 量化选股混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.6.1	19,873,328.11	13,010,382.43
结算备付金		26,050,526.54	46,629,432.31
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.6.2	607,278,166.16	934,881,621.54
其中：股票投资		577,961,868.93	930,467,325.76
基金投资		-	-
债券投资		29,316,297.23	4,414,295.78
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		570,192.67	-
应收申购款		208,004.79	6,604,047.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	-	-

资产总计		653,980,218.27	1,001,125,483.77
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		1,205,599.84	-
应付赎回款		10,828,989.02	6,849,495.70
应付管理人报酬		692,756.06	1,011,154.48
应付托管费		115,459.36	168,525.75
应付销售服务费		98,766.79	154,891.79
应付投资顾问费		-	-
应交税费		539.75	168.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	156,178.94	181,313.71
负债合计		13,098,289.76	8,365,549.82
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	422,681,426.05	641,243,526.54
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	218,200,502.46	351,516,407.41
净资产合计		640,881,928.51	992,759,933.95
负债和净资产总计		653,980,218.27	1,001,125,483.77

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 422,681,426.05 份。其中 A 类基金份额净值 1.5252 元，基金份额总额 300,017,978.25 份；C 类基金份额净值 1.4943 元，基金份额总额 122,663,447.80 份。

6.2 利润表

会计主体：博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-3,505,206.38	15,829,251.80
1.利息收入		30,526.36	16,212.14
其中：存款利息收入	6.4.6.9	30,526.36	16,212.14
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）		31,227,796.51	48,982.24
其中：股票投资收益	6.4.6.10	27,689,610.76	-4,238,802.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.11	46,007.92	-1,005.98
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	3,492,177.83	4,288,790.29
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	-35,539,722.18	15,374,310.54
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	776,192.93	389,746.88

减：二、营业总支出		7,703,125.94	3,577,438.45
1. 管理人报酬		5,793,680.22	2,503,110.59
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		965,613.35	417,185.12
3. 销售服务费		831,241.18	569,004.49
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		145.72	-
8. 其他费用	6.4.6.18	112,445.47	88,138.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,208,332.32	12,251,813.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,208,332.32	12,251,813.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-11,208,332.32	12,251,813.35

6.3 净资产变动表

会计主体：博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026年1月1日至2026年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	641,243,526.54	-	351,516,407.41	992,759,933.95
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	641,243,526.54	-	351,516,407.41	992,759,933.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-218,562,100.49	-	-133,315,904.95	-351,878,005.44
（一）、综合收益总额	-	-	-11,208,332.32	-11,208,332.32
（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）	-218,562,100.49	-	-122,107,572.63	-340,669,673.12
其中：1.基金申购款	278,714,651.21	-	174,145,812.12	452,860,463.33
2.基金赎回款	-497,276,751.70	-	-296,253,384.75	-793,530,136.45
（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	422,681,426.05	-	218,200,502.46	640,881,928.51

项目	上年度可比期间			
	2025年1月1日至2025年6月30日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	94,148,167.18	-	18,979,400.38	113,127,567.56
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	94,148,167.18	-	18,979,400.38	113,127,567.56
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	395,545,497.57	-	145,880,747.01	541,426,244.58
（一）、综合收益总额	-	-	12,251,813.35	12,251,813.35
（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）	395,545,497.57	-	133,628,933.66	529,174,431.23
其中：1.基金申购款	555,329,387.87	-	177,310,491.70	732,639,879.57
2.基金赎回款	-159,783,890.30	-	-43,681,558.04	-203,465,448.34
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	489,693,664.75	-	164,860,147.39	654,553,812.14

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 ESG 量化选股混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]453 号核准，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 ESG 量化选股混合型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，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 339,237,606.43 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2023）验字第 60669135_A11 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金基金合同》于 2023 年 3 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 339,308,429.83 份基金份额，其中认购资金利息折合 70,823.40 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，基金托管人为渣打银行（中国）有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行或上市的股票（含主板、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（国债、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换债、次级债等）、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、现金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相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为

60%-95%，港股通标的股票投资占股票资产的比例为 0-50%；本基金投资于 ESG 主题股票占非现金基金资产的比例不低于 80%。每个交易日日终在扣除国债期货、股票期权、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或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、应收申购款等。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：中证 800ESG 基准指数收益率*75%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+中债综合财富（总值）指数收益率*20%。

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	19,873,328.11
等于：本金	19,872,958.30
加：应计利息	369.81
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	19,873,328.11

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		623,387,464.91	-	577,961,868.93	-45,425,595.98
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	29,102,317.00	204,737.23	29,316,297.23	9,243.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	29,102,317.00	204,737.23	29,316,297.23	9,243.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		652,489,781.91	204,737.23	607,278,166.16	-45,416,352.98

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	6,059.34
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	859.45
预提费用	149,260.15
合计	156,178.94

6.4.6.7 实收基金

博时 ESG 量化选股混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	454,381,519.74	454,381,519.74
本期申购	153,267,208.20	153,267,208.20
本期赎回（以“-”号填列）	-307,630,749.69	-307,630,749.69
本期末	300,017,978.25	300,017,978.25

博时 ESG 量化选股混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	186,862,006.80	186,862,006.80
本期申购	125,447,443.01	125,447,443.01
本期赎回（以“-”号填列）	-189,646,002.01	-189,646,002.01
本期末	122,663,447.80	122,663,447.80

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 ESG 量化选股混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	171,152,623.27	81,174,651.41	252,327,274.68
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	171,152,623.27	81,174,651.41	252,327,274.68
本期利润	17,295,010.72	-22,757,448.21	-5,462,437.49
本期基金份额交易产生的变	-53,452,925.85	-35,844,032.23	-89,296,958.08

动数			
其中：基金申购款	57,003,759.83	42,127,523.54	99,131,283.37
基金赎回款	-110,456,685.68	-77,971,555.77	-188,428,241.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	134,994,708.14	22,573,170.97	157,567,879.11

博时 ESG 量化选股混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	66,026,725.27	33,162,407.46	99,189,132.73
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	66,026,725.27	33,162,407.46	99,189,132.73
本期利润	7,036,379.14	-12,782,273.97	-5,745,894.83
本期基金份额交易产生的变动数	-21,476,346.45	-11,334,268.10	-32,810,614.55
其中：基金申购款	44,524,848.68	30,489,680.07	75,014,528.75
基金赎回款	-66,001,195.13	-41,823,948.17	-107,825,143.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	51,586,757.96	9,045,865.39	60,632,623.35

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	10,203.12
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	12,005.28

其他	8,317.96
合计	30,526.36

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	2,050,255,642.76
减：卖出股票成本总额	2,018,660,647.54
减：交易费用	3,905,384.46
买卖股票差价收入	27,689,610.76

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	46,032.77
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-24.85
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	46,007.92

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	-

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）	-
成本总额	
减：应计利息总额	-
减：交易费用	24.85
买卖债券差价收入	-24.85

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	3,492,177.83
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	3,492,177.83

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	-35,539,722.18

——股票投资	-35,545,880.18
——债券投资	6,158.00
——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	-35,539,722.18

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	510,660.67
基金转换费收入	265,532.26
合计	776,192.93

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	14,762.13

银行汇划费	8,423.19
合计	112,445.47

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
渣打银行（中国）有限公司（“渣打银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,793,680.22	2,503,110.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,406,290.12	1,024,628.66
应支付基金管理人的净管理费	3,387,390.10	1,478,481.93

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 1.20% 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 × 1.20% / 当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	965,613.35	417,185.12

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 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 ESG 量化选 股混合 A	博时 ESG 量化选股混 合 C	合计
招商证券	-	460.31	460.31
博时基金	-	59,243.19	59,243.19
合计	-	59,703.50	59,703.50
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时 ESG 量化选 股混合 A	博时 ESG 量化选股混 合 C	合计
招商证券	-	244.50	244.50
博时基金	-	2,901.28	2,901.28

合计	-	3,145.78	3,145.78
----	---	----------	----------

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 0.60% 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 × 0.60% / 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		上年度可比期间	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
渣打银行-活期存款	19,873,328.11	10,203.12	9,584,223.84	4,467.10

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	001365	天海电子	网下发行	2,394.00	65,092.86
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
招商证券股份 有限公司	001388	信通电子	网下发行	937.00	15,385.54

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10 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	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

				型						
300750	宁德时代	2026-04-24	6个月	非公开发行限售	410.34	373.17	94,000.00	38,571,960.00	35,077,980.00	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9个月	首次公开发行限售	104.66	768.89	2,696.00	282,163.36	2,072,927.44	-
301666	大普微	2026-04-08	6个月	首次公开发行限售	46.08	463.33	1,220.00	56,217.60	565,262.60	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9个月	首次公开发行限售	22.68	42.16	6,335.00	143,677.80	267,083.60	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	首次公开发行限售	81.88	1,584.33	163.00	13,346.44	258,245.79	-
001248	华润新	2026-06-24	6个月	首次公	10.11	10.11	21,901.00	221,419.11	221,419.11	-

	能源			开发行限售						
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	首次公开发行限售	19.68	141.49	1,390.00	27,355.20	196,671.10	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	首次公开发行限售	9.47	70.14	1,717.00	16,259.99	120,430.38	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月	首次公开发行限售	69.66	160.06	714.00	49,737.24	114,282.84	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6个月	首次公开发行限售	10.12	27.73	3,996.00	40,439.52	110,809.08	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6个月	首次公开发行限售	44.56	468.67	207.00	9,223.92	97,014.69	-

				售						
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个交易日	新股未上市	10.11	10.11	9,385.00	94,882.35	94,882.35	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	首次公开发行限售	17.52	35.92	1,500.00	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	首次公开发行限售	92.18	463.15	116.00	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	首次公开发行限售	26.28	172.09	234.00	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	首次公开发行限售	40.98	308.19	128.00	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	首次公开发行	7.82	20.74	1,743.00	13,630.26	36,149.82	-

				限售						
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	首次公开发行限售	17.70	84.32	330.00	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026-05-11	6个月	首次公开发行限售	27.19	31.31	719.00	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研新材	2026-04-01	6个月	首次公开发行限售	6.41	24.13	834.00	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月	首次公开发行限售	24.68	86.80	216.00	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6个月	首次公开发行限售	53.26	58.74	285.00	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特	2026-06-02	6个月	首次	7.08	28.40	546.00	3,865.68	15,506.40	-

	电子		月	公 开 发 行 限 售						
30168 7	新 广 益	2025-12-2 4	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	21.93	77.78	195.00	4,276.35	15,167.10	-
00139 3	维 通 利	2026-05-0 8	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	30.38	38.99	387.00	11,757.06	15,089.13	-
30153 1	春 光 集 团	2026-04-2 8	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	13.30	51.56	290.00	3,857.00	14,952.40	-
30159 9	理 奇 智 能	2026-04-2 2	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	13.91	32.47	433.00	6,023.03	14,059.51	-
601112	振 石 股 份	2026-01-2 1	6 个 月	首 次 公 开 发 行	11.18	17.59	775.00	8,664.50	13,632.25	-

				限售						
301680	固德电材	2026-02-27	6个月	首次公开发行限售	58.00	112.16	117.00	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月	首次公开发行限售	78.38	121.77	96.00	7,524.48	11,689.92	-
688816	易思维	2026-02-04	6个月	首次公开发行限售	55.95	57.10	177.00	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	首次公开发行限售	13.86	73.46	137.00	1,898.82	10,064.02	-
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	-
603435	嘉德	2026-05-15	6个月	首次	15.76	46.71	104.00	1,639.04	4,857.84	-

	利		月	公 开 发 行 限 售						
60335 2	至 信 股 份	2026-01-0 8	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	21.88	25.52	112.00	2,450.56	2,858.24	-
60329 3	埃 泰 克	2026-04-0 9	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	33.49	33.93	72.00	2,411.28	2,442.96	-
00131 2	福 恩 股 份	2026-04-1 4	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	18.38	16.78	134.00	2,462.92	2,248.52	-
60328 4	林 平 发 展	2026-02-0 3	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	37.88	34.87	46.00	1,742.48	1,604.02	-
00122 0	世 盟 股 份	2026-01-2 7	6 个 月	首 次 公 开 发 行	28.00	27.78	57.00	1,596.00	1,583.46	-

				限售						
--	--	--	--	----	--	--	--	--	--	--

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
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	200.00	166,000.00	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。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本基金通过量化模型精选 ESG 主题证券，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、法律合规部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；法律合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金

管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	29,316,297.23	4,414,295.78
合计	29,316,297.23	4,414,295.78

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	19,873,328.11	-	-	-	19,873,328.11
结算备付金	26,050,526.54	-	-	-	26,050,526.54
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	29,316,297.23	-	-	-577,961,868.93	607,278,166.16
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	208,004.79	208,004.79
应收股利	-	-	-	570,192.67	570,192.67
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	75,240,151.88	-	-	-578,740,066.39	653,980,218.27
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	10,828,989.02	10,828,989.02
应付清算款	-	-	-	1,205,599.84	1,205,599.84

应付管理人报酬	-	-	-	692,756.06	692,756.06
应付托管费	-	-	-	115,459.36	115,459.36
应付销售服务费	-	-	-	98,766.79	98,766.79
应交税费	-	-	-	539.75	539.75
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	156,178.94	156,178.94
负债总计	-	-	-	13,098,289.76	13,098,289.76
利率敏感度缺口	75,240,151.88	-	-	-565,641,776.63	640,881,928.51
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	13,010,382.43	-	-	-	13,010,382.43
结算备付金	46,629,432.31	-	-	-	46,629,432.31
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	4,414,295.78	-	-	-930,467,325.76	934,881,621.54
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资 产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	6,604,047.49	6,604,047.49
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	64,054,110.52	-	-	-937,071,373.25	1,001,125,483.77
负债					
卖出回购金融资 产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	6,849,495.70	6,849,495.70
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,011,154.48	1,011,154.48
应付托管费	-	-	-	168,525.75	168,525.75
应付销售服务费	-	-	-	154,891.79	154,891.79
应交税费	-	-	-	168.39	168.39
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	181,313.71	181,313.71
负债总计	-	-	-	8,365,549.82	8,365,549.82
利率敏感度缺口	64,054,110.52	-	-	-928,705,823.43	992,759,933.95

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 3	减少约 1
	市场利率下降 25 个基点	增加约 3	增加约 1

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.12.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	228,950,511.34	228,950,511.34
资产合计	-	228,950,511.34	228,950,511.34
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	228,950,511.34	228,950,511.34
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	393,256,831.52	393,256,831.52
资产合计	-	393,256,831.52	393,256,831.52
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-

资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	393,256,831.52	393,256,831.52
-----------------------	---	----------------	----------------

6.4.12.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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
	1.所有港币均相对人民币升值 5%	增加约 1,145	增加约 1,966
	2.所有港币均相对人民币贬值 5%	减少约 1,145	减少约 1,966

注：以上金额为四舍五入后的结果。

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	577,961,868.93	90.18	930,467,325.76	93.73
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	577,961,868.93	90.18	930,467,325.76	93.73

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 3,270	增加约 8,948
	业绩比较基准下降 5%	减少约 3,270	减少约 8,948

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	538,113,018.07
第二层次	29,798,998.69
第三层次	39,366,149.40

合计	607,278,166.16
----	----------------

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	577,961,868.93	88.38
	其中：股票	577,961,868.93	88.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,316,297.23	4.48
	其中：债券	29,316,297.23	4.48
	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	45,923,854.65	7.02
8	其他各项资产	778,197.46	0.12
9	合计	653,980,218.27	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 228,950,511.34 元，净值占比 35.72%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	34,365.80	0.01
B	采矿业	6,534,707.82	1.02
C	制造业	203,585,559.34	31.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,000,524.46	1.72
E	建筑业	6,142.00	0.00
F	批发和零售业	788,955.20	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	7,690,528.46	1.20
H	住宿和餐饮业	14,392.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	76,076,710.39	11.87
J	金融业	37,337,086.12	5.83
K	房地产业	33,245.00	0.01
L	租赁和商务服务业	906,218.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	1,246,964.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	3,735,959.00	0.58
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,416.00	0.00

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	14,584.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	349,011,357.59	54.46

7.2.2 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	91,823,536.80	14.33
医疗保健	6,072,276.25	0.95
工业	39,533,703.50	6.17
日常消费品	1,890,103.77	0.29
电信业务	40,374,880.27	6.30
金融	3,327,807.64	0.52
非日常生活消费品	45,928,203.11	7.17
合计	228,950,511.34	35.72

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	01304	FORTIOR	291,300	35,573,011.27	5.55
1	688279	峰岬科技	104,909	23,545,775.96	3.67
2	300750	宁德时代	148,775	56,605,102.75	8.83
3	03690	美团-W	751,000	44,681,251.93	6.97
4	01810	小米集团-W	2,312,400	43,462,533.83	6.78
5	688018	乐鑫科技	334,889	42,839,000.88	6.68
6	02057	中通快递-W	265,250	39,533,703.50	6.17
7	09626	哔哩哔哩-W	313,820	35,897,253.14	5.60
8	301606	绿联科技	573,700	35,007,174.00	5.46
9	605499	东鹏饮料	252,200	31,129,046.00	4.86
9	09980	东鹏饮料	20,300	1,890,103.77	0.29
10	300693	盛弘股份	573,000	27,933,750.00	4.36
11	601688	华泰证券	944,000	19,465,280.00	3.04
12	00285	比亚迪电子	621,500	11,292,696.02	1.76
13	003816	中国广核	2,529,900	9,891,909.00	1.54
14	601066	中信建投	271,700	7,898,319.00	1.23
15	688256	寒武纪	4,521	7,213,481.55	1.13

16	300576	容大感光	134,610	6,894,724.20	1.08
17	688008	澜起科技	20,023	6,205,127.70	0.97
18	601021	春秋航空	119,800	5,460,484.00	0.85
19	09899	网易云音乐	50,100	4,477,627.13	0.70
20	600938	中国海油	157,600	4,278,840.00	0.67
21	002736	国信证券	387,500	3,871,125.00	0.60
22	09926	康方生物	50,000	3,823,791.38	0.60
23	301305	朗坤科技	127,800	3,644,856.00	0.57
24	300054	鼎龙股份	28,890	3,061,473.30	0.48
25	688802	沐曦股份	2,696	2,072,927.44	0.32
26	603259	药明康德	9,500	1,182,845.00	0.18
26	02359	药明康德	6,200	827,676.04	0.13
27	600036	招商银行	51,900	1,842,450.00	0.29
28	02328	中国财险	146,000	1,815,894.86	0.28
29	603986	兆易创新	2,000	1,630,000.00	0.25
30	300618	寒锐钴业	43,100	1,538,670.00	0.24
31	00966	中国太平	96,600	1,511,912.78	0.24
32	01347	华虹宏力	8,000	1,495,295.68	0.23
33	002384	东山精密	5,500	1,442,925.00	0.23
34	06160	百济神州	9,600	1,420,808.83	0.22
35	601899	紫金矿业	55,000	1,382,700.00	0.22
36	600030	中信证券	41,200	1,183,676.00	0.18
37	600183	生益科技	6,800	1,179,120.00	0.18
38	600887	伊利股份	48,200	1,154,872.00	0.18
39	002463	沪电股份	7,400	1,130,720.00	0.18
40	600150	中国船舶	32,900	1,111,691.00	0.17
41	600176	中国巨石	14,300	1,042,184.00	0.16
42	301308	江波龙	1,400	985,320.00	0.15
43	002415	海康威视	27,700	947,340.00	0.15
44	688396	华润微	9,500	926,725.00	0.14
45	688002	睿创微纳	5,600	866,264.00	0.14
46	002558	巨人网络	30,200	832,312.00	0.13
47	605117	德业股份	7,720	819,709.60	0.13
48	000776	广发证券	34,800	814,320.00	0.13
49	002027	分众传媒	166,300	804,892.00	0.13
50	600233	圆通速递	51,000	803,250.00	0.13
51	300408	三环集团	4,700	784,430.00	0.12
52	601995	中金公司	21,300	769,995.00	0.12
53	600026	中远海能	41,200	739,128.00	0.12
54	000685	中山公用	66,100	737,676.00	0.12
55	300681	英搏尔	25,500	729,810.00	0.11
56	000408	藏格矿业	10,500	727,860.00	0.11
57	002493	荣盛石化	67,600	726,700.00	0.11

58	600346	恒力石化	40,800	722,568.00	0.11
59	600519	贵州茅台	600	711,294.00	0.11
60	603345	安井食品	8,800	705,672.00	0.11
61	600489	中金黄金	38,500	694,925.00	0.11
62	000807	云铝股份	30,500	675,270.00	0.11
63	600251	冠农股份	77,000	665,280.00	0.10
64	603317	天味食品	50,100	651,801.00	0.10
65	002532	天山铝业	60,700	651,311.00	0.10
66	06862	海底捞	69,000	636,456.07	0.10
67	601872	招商轮船	35,900	630,763.00	0.10
68	300972	万辰集团	3,600	624,276.00	0.10
69	000338	潍柴动力	22,700	618,575.00	0.10
70	002154	报喜鸟	160,800	572,448.00	0.09
71	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.09
72	600309	万华化学	7,800	533,598.00	0.08
73	002961	瑞达期货	26,100	511,038.00	0.08
74	09992	泡泡玛特	3,600	483,712.87	0.08
75	600522	中天科技	6,300	382,284.00	0.06
76	601360	三六零	43,700	379,753.00	0.06
77	601318	中国平安	7,800	372,372.00	0.06
78	001248	华润新能源	31,286	316,301.46	0.05
79	600487	亨通光电	2,600	284,284.00	0.04
80	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.04
81	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.04
82	603195	公牛集团	6,200	242,730.00	0.04
83	300773	拉卡拉	15,140	231,642.00	0.04
84	002956	西麦食品	10,800	224,208.00	0.03
85	002517	恺英网络	12,700	206,375.00	0.03
86	688820	盛合晶微	1,390	196,671.10	0.03
87	601108	财通证券	21,000	181,650.00	0.03
88	002008	大族激光	1,200	180,132.00	0.03
89	688072	拓荆科技	200	166,400.00	0.03
90	603699	纽威股份	3,300	165,990.00	0.03
91	688981	中芯国际	1,028	163,266.96	0.03
92	688702	盛科通信	400	155,996.00	0.02
93	601231	环旭电子	4,500	145,800.00	0.02
94	000792	盐湖股份	4,700	141,893.00	0.02
95	688059	华锐精密	700	139,797.00	0.02
96	688388	嘉元科技	3,000	132,000.00	0.02
97	603901	永创智能	11,900	129,353.00	0.02
98	002709	天赐材料	2,500	128,575.00	0.02
99	002281	光迅科技	500	128,470.00	0.02
100	603239	浙江仙通	8,600	127,366.00	0.02

101	301031	中熔电气	1,048	125,183.60	0.02
102	605060	联德股份	2,200	124,828.00	0.02
103	688378	奥来德	2,000	124,000.00	0.02
104	002284	亚太股份	12,900	122,421.00	0.02
105	300113	顺网科技	6,700	122,007.00	0.02
106	002487	大金重工	2,100	121,737.00	0.02
107	600320	振华重工	29,400	121,422.00	0.02
108	600570	恒生电子	5,700	120,783.00	0.02
109	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.02
110	601208	东材科技	1,700	120,343.00	0.02
111	605016	百龙创园	4,600	118,910.00	0.02
112	001389	广合科技	500	118,625.00	0.02
113	002250	联化科技	8,600	117,562.00	0.02
114	002545	东方铁塔	7,200	116,784.00	0.02
115	600989	宝丰能源	5,700	115,881.00	0.02
116	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.02
117	09988	阿里巴巴-W	1,400	112,902.81	0.02
118	688521	芯原股份	300	111,342.00	0.02
119	300398	飞凯材料	1,800	111,150.00	0.02
120	001399	惠科股份	3,996	110,809.08	0.02
121	300373	扬杰科技	700	110,061.00	0.02
122	002859	洁美科技	1,000	109,510.00	0.02
123	300857	协创数据	300	101,970.00	0.02
124	300223	北京君正	400	99,560.00	0.02
125	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.02
126	300033	同花顺	400	96,400.00	0.02
127	300919	中伟新材	2,200	96,250.00	0.02
128	688012	中微公司	200	93,700.00	0.01
129	688392	骄成超声	400	90,872.00	0.01
130	002271	东方雨虹	6,700	79,529.00	0.01
131	300059	东方财富	3,500	71,330.00	0.01
132	600482	中国动力	2,100	68,880.00	0.01
133	300604	长川科技	200	68,284.00	0.01
134	000895	双汇发展	3,000	67,200.00	0.01
135	301536	星宸科技	500	64,355.00	0.01
136	688111	金山办公	300	63,915.00	0.01
137	002266	浙富控股	12,500	63,250.00	0.01
138	300590	移为通信	4,400	63,140.00	0.01
139	600499	科达制造	4,400	60,720.00	0.01
140	300012	华测检测	4,000	55,440.00	0.01
141	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.01
142	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
143	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01

144	603233	大参林	3,500	52,605.00	0.01
145	601233	桐昆股份	2,400	51,960.00	0.01
146	688525	佰维存储	100	49,473.00	0.01
147	688628	优利德	500	49,470.00	0.01
148	000933	神火股份	2,200	46,640.00	0.01
149	688400	凌云光	700	46,340.00	0.01
150	002273	水晶光电	1,300	46,124.00	0.01
151	002747	埃斯顿	1,200	44,796.00	0.01
152	000783	长江证券	4,400	42,900.00	0.01
153	688123	聚辰股份	200	42,520.00	0.01
154	603638	艾迪精密	1,800	42,210.00	0.01
155	002886	沃特股份	1,500	42,135.00	0.01
156	600885	宏发股份	1,200	41,388.00	0.01
157	002120	韵达股份	6,500	41,340.00	0.01
158	002115	三维通信	4,000	41,200.00	0.01
159	601500	通用股份	11,200	40,880.00	0.01
160	002064	华峰化学	4,300	40,807.00	0.01
161	688257	新锐股份	400	40,760.00	0.01
162	600268	国电南自	3,500	40,670.00	0.01
163	688469	芯联集成	3,800	40,318.00	0.01
164	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
165	603187	海容冷链	3,500	40,215.00	0.01
166	301486	致尚科技	193	40,205.76	0.01
167	688206	概伦电子	900	39,933.00	0.01
168	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
169	300856	科思股份	3,700	39,442.00	0.01
170	002779	中坚科技	500	39,280.00	0.01
171	000415	渤海租赁	9,600	39,072.00	0.01
172	600230	沧州大化	3,000	39,060.00	0.01
173	000951	中国重汽	2,000	39,020.00	0.01
174	301358	湖南裕能	500	37,935.00	0.01
175	002340	格林美	5,600	37,016.00	0.01
176	601061	中信金属	3,400	36,618.00	0.01
177	000426	兴业银锡	1,100	36,256.00	0.01
178	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
179	000987	越秀资本	4,600	35,972.00	0.01
180	002436	兴森科技	700	35,665.00	0.01
181	002738	中矿资源	600	35,394.00	0.01
182	688266	泽璟制药	300	34,998.00	0.01
183	002410	广联达	4,100	33,456.00	0.01
184	600566	济川药业	1,500	33,285.00	0.01
185	001339	智微智能	320	32,729.60	0.01
186	000703	恒逸石化	2,400	32,568.00	0.01

186	601168	西部矿业	1,200	32,568.00	0.01
187	600109	国金证券	3,700	32,486.00	0.01
188	000683	博源化工	5,600	32,256.00	0.01
189	688090	瑞松科技	300	31,935.00	0.00
190	002299	圣农发展	2,100	31,836.00	0.00
191	000750	国海证券	8,300	30,544.00	0.00
192	300073	当升科技	600	28,824.00	0.00
193	300037	新宙邦	300	27,855.00	0.00
194	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
195	000060	中金岭南	3,600	27,252.00	0.00
196	000423	东阿阿胶	600	27,216.00	0.00
197	300395	菲利华	200	26,746.00	0.00
198	000034	神州数码	960	26,640.00	0.00
199	600711	盛屯矿业	2,400	26,328.00	0.00
200	000021	深科技	400	25,708.00	0.00
201	688327	云从科技	2,000	24,920.00	0.00
202	001218	丽臣实业	1,100	24,266.00	0.00
203	600598	北大荒	2,200	23,848.00	0.00
204	600900	长江电力	900	23,823.00	0.00
205	002152	广电运通	2,500	23,450.00	0.00
206	600497	驰宏锌锗	1,900	23,009.00	0.00
207	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
208	002185	华天科技	1,000	22,310.00	0.00
209	688213	思特威	200	21,414.00	0.00
210	000960	锡业股份	500	21,345.00	0.00
211	002078	太阳纸业	1,700	21,233.00	0.00
212	600312	平高电气	1,200	21,192.00	0.00
213	600927	永安期货	1,700	21,165.00	0.00
214	688099	晶晨股份	200	20,580.00	0.00
215	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
216	603816	顾家家居	900	20,124.00	0.00
217	002126	银轮股份	400	19,920.00	0.00
218	601211	国泰海通	1,064	19,364.80	0.00
219	000657	中钨高新	200	19,144.00	0.00
220	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
221	300623	捷捷微电	400	17,996.00	0.00
222	600685	中船防务	700	17,808.00	0.00
223	600089	特变电工	750	16,875.00	0.00
224	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
225	600583	海油工程	3,300	16,599.00	0.00
226	601155	新城控股	1,600	16,416.00	0.00
227	002111	威海广泰	1,800	16,200.00	0.00
228	600995	南网储能	1,300	15,990.00	0.00

229	300458	全志科技	400	15,784.00	0.00
230	002396	星网锐捷	820	15,719.40	0.00
231	300098	高新兴	3,400	15,606.00	0.00
232	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
233	600998	九州通	3,280	15,383.20	0.00
234	002353	杰瑞股份	100	15,250.00	0.00
235	002170	芭田股份	1,400	15,204.00	0.00
236	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
237	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
238	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
239	603156	养元饮品	300	14,721.00	0.00
240	300140	节能环境	2,900	14,413.00	0.00
241	603920	世运电路	300	14,412.00	0.00
242	600754	锦江酒店	800	14,392.00	0.00
243	600765	中航重机	1,100	14,212.00	0.00
244	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
245	09987	百胜中国	50	13,879.43	0.00
246	300573	兴齐眼药	335	13,654.60	0.00
247	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
248	300146	汤臣倍健	1,500	13,560.00	0.00
249	600177	雅戈尔	1,800	13,554.00	0.00
250	002603	以岭药业	900	13,500.00	0.00
251	600196	复星医药	600	13,482.00	0.00
252	603588	高能环境	700	13,440.00	0.00
253	600352	浙江龙盛	1,100	13,321.00	0.00
254	603606	东方电缆	320	13,283.20	0.00
255	600380	健康元	1,400	13,188.00	0.00
256	601600	中国铝业	1,600	13,152.00	0.00
257	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
258	688486	龙迅股份	200	12,716.00	0.00
259	603939	益丰药房	700	12,586.00	0.00
260	601877	正泰电器	500	12,535.00	0.00
261	002444	巨星科技	400	12,440.00	0.00
262	000768	中航西飞	600	12,288.00	0.00
263	000893	亚钾国际	300	12,267.00	0.00
264	002926	华西证券	1,500	12,255.00	0.00
265	600884	杉杉股份	900	12,195.00	0.00
266	601019	山东出版	1,900	12,160.00	0.00
267	600332	白云山	600	12,024.00	0.00
268	300136	信维通信	100	11,925.00	0.00
269	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
270	601857	中国石油	1,300	11,284.00	0.00
271	002249	大洋电机	1,500	11,250.00	0.00

272	600166	福田汽车	3,800	11,058.00	0.00
273	600801	华新建材	700	10,920.00	0.00
274	002500	山西证券	2,000	10,320.00	0.00
275	300285	国瓷材料	100	10,318.00	0.00
276	688563	航材股份	200	10,246.00	0.00
277	300970	华绿生物	560	10,236.80	0.00
278	600015	华夏银行	1,600	10,224.00	0.00
279	000581	威孚高科	600	10,212.00	0.00
280	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
281	688208	道通科技	400	10,076.00	0.00
282	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
283	600577	精达股份	1,000	9,780.00	0.00
284	601156	东航物流	600	9,672.00	0.00
285	600602	云赛智联	600	9,648.00	0.00
286	300770	新媒股份	300	9,447.00	0.00
287	002262	恩华药业	500	9,375.00	0.00
288	001287	中电港	300	9,345.00	0.00
289	600741	华域汽车	600	9,312.00	0.00
290	000555	神州信息	900	9,270.00	0.00
291	688439	振华风光	200	9,240.00	0.00
292	002195	岩山科技	1,400	9,156.00	0.00
293	603993	洛阳钼业	500	8,775.00	0.00
294	002050	三花智控	200	8,766.00	0.00
295	300759	康龙化成	300	8,679.00	0.00
296	000513	丽珠集团	300	8,667.00	0.00
297	600941	中国移动	100	8,613.00	0.00
298	300699	光威复材	300	8,595.00	0.00
299	002065	东华软件	1,200	8,568.00	0.00
300	002001	新和成	300	8,526.00	0.00
301	603338	浙江鼎力	200	8,500.00	0.00
302	000612	焦作万方	800	8,472.00	0.00
303	601166	兴业银行	500	8,280.00	0.00
304	002423	中粮资本	1,000	8,230.00	0.00
305	002400	省广集团	1,300	8,203.00	0.00
306	000676	智度股份	1,600	8,176.00	0.00
307	600690	海尔智家	400	8,164.00	0.00
308	600066	宇通客车	300	8,043.00	0.00
309	600369	西南证券	2,000	8,040.00	0.00
310	600988	赤峰黄金	300	7,896.00	0.00
311	002063	远光软件	1,500	7,650.00	0.00
312	002156	通富微电	100	7,587.00	0.00
313	000333	美的集团	100	7,553.00	0.00
314	600211	西藏药业	200	7,478.00	0.00

315	600329	达仁堂	200	7,444.00	0.00
316	001914	招商积余	900	7,344.00	0.00
317	002138	顺络电子	100	7,310.00	0.00
318	603298	杭叉集团	300	7,158.00	0.00
319	688385	复旦微电	100	7,129.00	0.00
320	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
321	600517	国网英大	1,500	7,020.00	0.00
322	002841	视源股份	200	6,906.00	0.00
323	000528	柳工	900	6,795.00	0.00
324	601689	拓普集团	120	6,770.40	0.00
325	600480	凌云股份	800	6,648.00	0.00
326	603288	海天味业	200	6,632.00	0.00
327	603556	海兴电力	300	6,600.00	0.00
328	002922	伊戈尔	200	6,560.00	0.00
329	000708	中信特钢	500	6,310.00	0.00
330	002466	天齐锂业	100	6,132.00	0.00
331	002838	道恩股份	200	6,124.00	0.00
332	603728	鸣志电器	100	6,092.00	0.00
333	000629	钒钛股份	1,800	6,012.00	0.00
334	603279	景津装备	500	6,000.00	0.00
335	300415	伊之密	300	5,973.00	0.00
336	002006	精工科技	400	5,884.00	0.00
337	600416	湘电股份	600	5,880.00	0.00
338	603659	璞泰来	200	5,786.00	0.00
339	002690	美亚光电	400	5,732.00	0.00
340	002270	华明装备	300	5,655.00	0.00
341	000738	航发控制	300	5,487.00	0.00
342	688475	萤石网络	200	5,470.00	0.00
343	605098	行动教育	100	5,416.00	0.00
344	600361	创新新材	1,500	5,400.00	0.00
345	002335	科华数据	125	5,306.25	0.00
346	601319	中国人保	782	5,286.32	0.00
347	000650	仁和药业	1,000	5,090.00	0.00
348	603927	中科软	400	5,084.00	0.00
349	600038	中直股份	200	5,058.00	0.00
350	600064	南京高科	700	4,991.00	0.00
351	603515	欧普照明	300	4,902.00	0.00
352	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
353	603799	华友钴业	100	4,826.00	0.00
354	688561	奇安信	200	4,796.00	0.00
355	600143	金发科技	300	4,635.00	0.00
356	600848	上海临港	600	4,494.00	0.00
357	002311	海大集团	100	4,461.00	0.00

358	600131	国网信通	300	4,380.00	0.00
358	603858	步长制药	300	4,380.00	0.00
359	600132	重庆啤酒	100	4,130.00	0.00
360	605599	菜百股份	300	4,110.00	0.00
361	002293	罗莱生活	410	4,054.90	0.00
362	600478	科力远	800	4,032.00	0.00
363	600389	江山股份	200	3,904.00	0.00
364	300017	网宿科技	300	3,903.00	0.00
365	600737	中粮糖业	300	3,699.00	0.00
366	600298	安琪酵母	100	3,620.00	0.00
367	000887	中鼎股份	200	3,578.00	0.00
368	300184	力源信息	200	3,510.00	0.00
369	600502	安徽建工	800	3,480.00	0.00
370	000883	湖北能源	800	3,456.00	0.00
371	300034	钢研高纳	200	3,428.00	0.00
372	603558	健盛集团	300	3,327.00	0.00
373	002131	利欧股份	700	3,325.00	0.00
374	002043	兔宝宝	300	3,324.00	0.00
375	000591	太阳能	700	3,220.00	0.00
376	600867	通化东宝	400	3,216.00	0.00
377	000967	盈峰环境	300	3,159.00	0.00
378	601728	中国电信	600	3,114.00	0.00
379	300319	麦捷科技	100	2,963.00	0.00
380	603565	中谷物流	300	2,943.00	0.00
381	600388	龙净环保	200	2,910.00	0.00
382	600875	东方电气	100	2,877.00	0.00
383	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
384	601139	深圳燃气	500	2,830.00	0.00
385	688599	天合光能	200	2,824.00	0.00
386	300115	长盈精密	100	2,794.00	0.00
387	600390	五矿资本	600	2,736.00	0.00
388	600008	首创环保	1,000	2,720.00	0.00
389	600606	绿地控股	2,200	2,662.00	0.00
390	600535	天士力	200	2,646.00	0.00
391	603596	伯特利	100	2,484.00	0.00
392	600655	豫园股份	600	2,466.00	0.00
393	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
394	603118	共进股份	200	2,422.00	0.00
395	002155	湖南黄金	100	2,387.00	0.00
396	601311	骆驼股份	300	2,337.00	0.00
397	601058	赛轮轮胎	200	2,306.00	0.00
398	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
399	600909	华安证券	200	2,222.00	0.00

400	000400	许继电气	100	2,170.00	0.00
401	600688	上海石化	600	1,758.00	0.00
402	603806	福斯特	100	1,679.00	0.00
403	000739	普洛药业	100	1,666.00	0.00
404	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
405	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
406	600803	新奥股份	100	1,580.00	0.00
407	603013	亚普股份	100	1,579.00	0.00
408	600110	诺德股份	100	1,509.00	0.00
409	600704	物产中大	300	1,416.00	0.00
410	000429	粤高速 A	100	1,365.00	0.00
411	603025	大豪科技	100	1,364.00	0.00
412	600185	珠免集团	300	1,350.00	0.00
413	601921	浙版传媒	200	1,338.00	0.00
414	002465	海格通信	100	1,277.00	0.00
415	000009	中国宝安	200	1,246.00	0.00
416	002624	完美世界	100	1,242.00	0.00
417	601615	明阳智能	100	1,157.00	0.00
418	600435	北方导航	100	1,120.00	0.00
419	300171	东富龙	100	1,106.00	0.00
420	601900	南方传媒	100	1,086.00	0.00
421	600372	中航机载	100	1,085.00	0.00
422	600483	福能股份	100	1,019.00	0.00
423	002701	奥瑞金	200	852.00	0.00
424	000686	东北证券	100	840.00	0.00
425	600637	东方明珠	100	831.00	0.00
426	300228	富瑞特装	100	740.00	0.00
427	000157	中联重科	100	697.00	0.00
428	000630	铜陵有色	100	636.00	0.00
429	002204	大连重工	100	528.00	0.00
430	002442	龙星科技	100	493.00	0.00
431	600866	星湖科技	100	439.00	0.00
432	002157	正邦科技	100	281.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	129,374,703.00	13.03
2	00700	腾讯控股	79,104,790.28	7.97

3	688008	澜起科技	71,402,946.46	7.19
4	300054	鼎龙股份	68,974,491.63	6.95
5	01810	小米集团－W	56,040,056.01	5.64
6	09626	哔哩哔哩－W	55,496,900.30	5.59
7	301486	致尚科技	54,784,241.51	5.52
8	03690	美团－W	47,296,203.44	4.76
9	02057	中通快递－W	45,738,997.00	4.61
10	03896	金山云	44,934,137.13	4.53
11	605499	东鹏饮料	43,736,430.05	4.41
12	688256	寒武纪	40,225,474.91	4.05
13	01347	华虹宏力	38,914,874.50	3.92
14	002558	巨人网络	38,349,850.60	3.86
15	01304	FORTIOR	35,874,866.62	3.61
16	09988	阿里巴巴－W	31,073,985.64	3.13
17	00966	中国太平	30,350,314.26	3.06
18	300693	盛弘股份	27,901,361.00	2.81
19	601688	华泰证券	24,701,323.00	2.49
20	01024	快手－W	18,956,645.09	1.91

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产 净值比例（%）
1	688008	澜起科技	118,205,709.14	11.91
2	300054	鼎龙股份	90,748,764.79	9.14
3	09988	阿里巴巴－W	81,896,549.87	8.25
4	00700	腾讯控股	78,281,906.80	7.89
5	01347	华虹宏力	77,989,965.12	7.86
6	300750	宁德时代	77,780,131.95	7.83
7	301486	致尚科技	75,117,514.76	7.57
8	09626	哔哩哔哩－W	62,885,840.35	6.33
9	688249	晶合集成	62,125,373.46	6.26
10	688220	翱捷科技	53,570,867.93	5.40
11	01810	小米集团－W	51,044,531.52	5.14
12	002558	巨人网络	50,860,329.00	5.12
13	00966	中国太平	48,135,932.64	4.85
14	00388	香港交易所	47,643,751.83	4.80
15	01024	快手－W	45,129,951.81	4.55
16	688256	寒武纪	36,190,745.42	3.65
17	688018	乐鑫科技	35,211,142.30	3.55

18	03896	金山云	31,672,117.62	3.19
19	00981	中芯国际	26,186,855.64	2.64
20	002847	盐津铺子	23,326,397.90	2.35
21	688279	峰昭科技	22,309,551.07	2.25

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	1,701,701,070.89
卖出股票的收入（成交）总额	2,050,255,642.76

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	29,316,297.23	4.57
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,316,297.23	4.57

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	019827	26 国债 01	102,000	10,266,115.56	1.60
2	019785	25 国债 13	73,000	7,392,166.00	1.15
3	019835	26 国债 09	72,000	7,211,849.42	1.13
4	019792	25 国债 19	44,000	4,446,166.25	0.69

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	570,192.67
4	应收利息	-
5	应收申购款	208,004.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	778,197.46

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净值 比例(%)	流通受限情况说 明
1	300750	宁德时代	35,077,980.00	5.47	非公开发行限售

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

份额级别	持有人户 数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
博时 ESG 量化选 股混合 A	9,610	31,219.35	22,299,237.18	7.43%	277,718,741.07	92.57%

博时 ESG 量化选股混合 C	3,842	31,926.98	2,937,619.03	2.39%	119,725,828.77	97.61%
合计	13,340	31,685.26	25,236,856.21	5.97%	397,444,569.84	94.03%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	46.97%

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

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

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

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易，剔除场内相关数据（如有）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时 ESG 量化选股混合 A	1,169,384.90	0.39%
	博时 ESG 量化选股混合 C	-	-
	合计	1,169,384.90	0.28%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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 ESG 量化选股混合 A	-
	博时 ESG 量化选股混合 C	-
	合计	-

本基金基金经理持有本开放式基金	博时 ESG 量化选股混合 A	>100
	博时 ESG 量化选股混合 C	-
	合计	>100

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 ESG 量化选股混合 A	博时 ESG 量化选股混合 C
基金合同生效日（2023 年 3 月 31 日）基金份额总额	231,894,319.44	107,414,110.39
本报告期期初基金份额总额	454,381,519.74	186,862,006.80
本报告期基金总申购份额	153,267,208.20	125,447,443.01
减：本报告期基金总赎回份额	307,630,749.69	189,646,002.01
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	300,017,978.25	122,663,447.80

§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。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年起改聘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

本报告期内，托管人未受到调查或处罚。

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，托管人的相关从业人员未受到调查或处罚。

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	
国元证券	3	3,710,463,282.47	100.00%	1,716,090.77	100.00%	增加 1 个

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序

(1) 本公司根据法规要求制定《博时基金公募基金证券交易佣金分配管理办法》，明确选择证

券公司参与证券交易的标准和程序，并建立证券公司的准入管理机制，符合筛选标准的证券公司可纳入公司证券公司白名单库，并持续动态管理。

(2) 本公司选择证券公司参与证券交易的主要标准是财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。严禁基金销售业务人员参与证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

(3) 本公司依据上述标准进行评估并确定证券公司，与其签订交易单元租用协议或证券经纪服务协议。

10.7.2 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
国元证券	24,704,082.00	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 ESG 量化选股混合型证券投资基金(博时 ESG 量化选股混合 A) 基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-26
2	博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金(博时 ESG 量化选股混合 C) 基金产品资料概要更新	证券日报、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	证券日报、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	证券日报、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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-30
6	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-28

7	博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证券日报、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）	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31
9	博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金 2025 年年度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31
10	博时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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-26
11	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-14
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-20260124	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-24
13	博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	证券日报、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 ESG 量化选股混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时 ESG 量化选股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 ESG 量化选股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 ESG 量化选股混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日