

博时量化多策略股票型证券投资基金

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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	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	5
§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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	61
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	61
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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62

7.12 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 盈利投资者数量占比	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§9 开放式基金份额变动	64
§10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	65
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	66
10.8 其他重大事件	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时量化多策略股票型证券投资基金	
基金简称	博时量化多策略股票	
基金主代码	005635	
交易代码	005635	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 4 月 3 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	143,515,144.27 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
下属分级基金的交易代码	005635	005636
报告期末下属分级基金的份额总额	114,247,842.61 份	29,267,301.66 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用科学的量化方法，把握市场规律，跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势，并针对当前市场风格特点，选择因子和构建策略组合，力求获取长期相对市场的超额收益。
投资策略	1、量化选股策略（1）A 股投资策略：本基金的选股策略以量化多策略体系为基础，涵盖因子打分、事件驱动、量价特征等多种投资逻辑。其中因子打分策略主要包括价值、成长、质量、市场情绪和分析师预期等因子，事件策略包括高管增持、股权激励、定向增发等，各个策略自成体系，具有各自的投资逻辑和风险特（2）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港股市场的投资机会。2、其他投资策略：存托凭证投资策略、债券投资策略、权证投资策略、资产支持证券

	的投资策略、金融衍生品投资策略。
业绩比较基准	中证全指指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于高风险/收益的基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	张姗
	联系电话	0755-83169999	400-61-95555
	电子邮箱	service@bosera.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	400-61-95555
传真		0755-83195140	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518040	518040
法定代表人		张东	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://www.bosera.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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）	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
本期已实现收益	20,648,767.53	12,258,961.88
本期利润	49,437,460.23	19,843,449.95
加权平均基金份额本期利润	0.3156	0.1711
本期加权平均净值利润率	17.68%	10.09%
本期基金份额净值增长率	24.40%	23.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
期末可供分配利润	86,215,995.74	19,890,224.05
期末可供分配基金份额利润	0.7546	0.6796
期末基金资产净值	239,013,659.49	58,623,053.13
期末基金份额净值	2.0921	2.0030
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
基金份额累计净值增长率	154.34%	138.00%

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

博时量化多策略股票 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	24.69%	1.48%	6.48%	1.12%	18.21%	0.36%
过去六个月	24.40%	1.37%	4.18%	1.11%	20.22%	0.26%
过去一年	64.47%	1.21%	19.91%	0.98%	44.56%	0.23%
过去三年	66.75%	1.20%	29.78%	1.11%	36.97%	0.09%
过去五年	56.40%	1.11%	8.10%	1.08%	48.30%	0.03%
过去七年	162.69%	1.12%	40.49%	1.08%	122.20%	0.04%
自基金合同生效起至今	154.34%	1.16%	31.95%	1.10%	122.39%	0.06%

博时量化多策略股票 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	24.44%	1.48%	6.48%	1.12%	17.96%	0.36%
过去六个月	23.89%	1.37%	4.18%	1.11%	19.71%	0.26%
过去一年	63.15%	1.21%	19.91%	0.98%	43.24%	0.23%
过去三年	62.79%	1.20%	29.78%	1.11%	33.01%	0.09%
过去五年	50.23%	1.11%	8.10%	1.08%	42.13%	0.03%
过去七年	148.27%	1.12%	40.49%	1.08%	107.78%	0.04%
自基金合同生效起至今	138.00%	1.16%	31.95%	1.10%	106.05%	0.06%

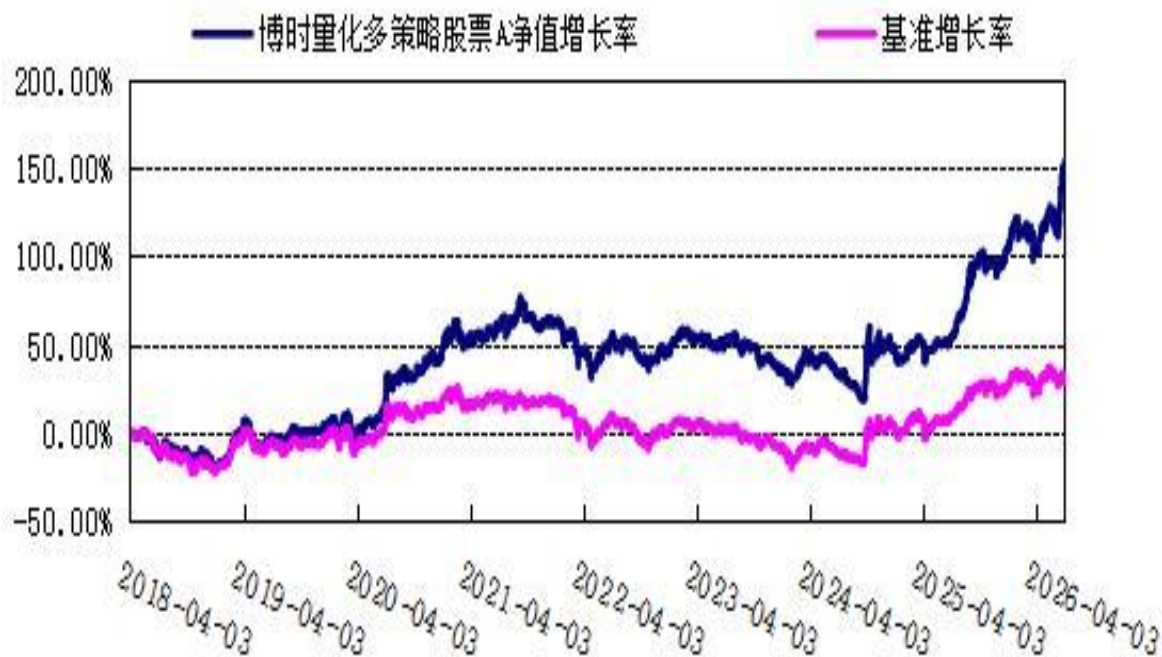
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时量化多策略股票型证券投资基金

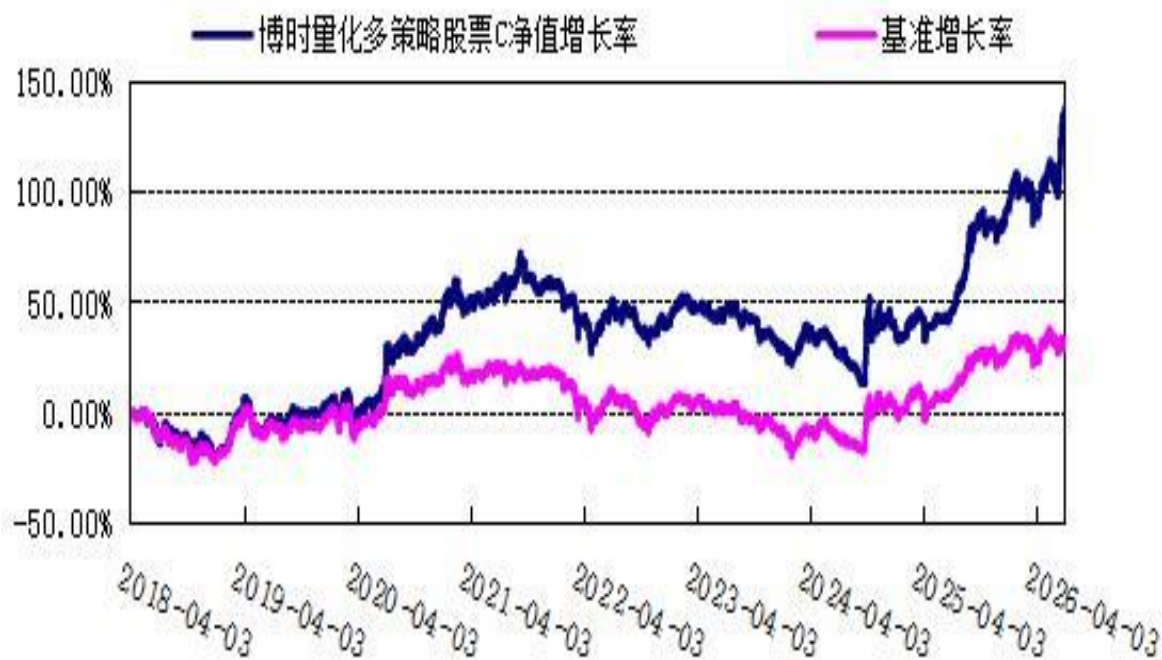
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 4 月 3 日至 2026 年 6 月 30 日)

博时量化多策略股票 A



博时量化多策略股票 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		
刘玉强	基金经理	2025-11-03	-	10.9	刘玉强先生，硕士。2015 年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。曾任研究员、基金经理助理。现任博时专精特新主题混合型证券投资基金(2023 年 2 月 1 日—至今)、博时上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 2 月 26 日—至今)、博时上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2025 年 4 月 8 日—至今)、博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金(2025 年 4 月 29 日—至今)、博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 6 月 18 日—至今)、博时上证综合指数增强型证券投资基金(2025 年 7 月 17 日—至今)、博时量化多策略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

2026 年一季度，A 股市场冲高回落、整体宽幅震荡；1-2 月中小盘成长领涨，上证指数一度上行至接近 4200 点，3 月受海外地缘冲突冲击，市场风险偏好显著下行，红利价值、大盘板块相对占优。中东冲突升级是一季度后半段核心压制因素，国际能源价格暴涨推升全球通胀，压缩海外央行宽松空间，叠加全球衰退担忧压制外需预期，流动性收紧预期持续约束 A 股估值。

二季度市场极致分化：3 月末至 4 月初市场探明阶段底部，沪深 300 年内最大回撤约 5%；4 月起中东地缘缓和、一季报业绩窗口期来临，盈利修复预期带动市场修复上行，成长风格全面占优，AI 产业链成为核心主线。指数层面 2026 上半年科创综指、创业板指分别上涨约 54%、35.6%，上证指数上涨约 3.2%，北证 50 下跌约 13.1%；中信一级行业中电子、通信分别上涨 85.5%、74.5%领涨，消费服务、农林牧渔表现偏弱。风格上成长显著跑赢大盘价值，但行情高度集中，全市场近七成个股下跌，个股涨幅中位数约-15%，指数与个股收益显著分化。

外部层面，二季度原油价格一度突破 110 美元/桶，推升输入性通胀；6 月中旬地缘缓和后油价回落至 80 美元/桶下方，通胀压力边际缓解。国内政策延续“稳中求进”，十五五规划落地推进，企业盈利修复预期持续升温。

本基金为量化多策略产品，2026 年上半年市场呈现“一季度震荡、二季度极致成长”的剧烈风格切换特征，单一静态因子模型难以适配快速轮动行情，对量化模型的风格暴露与轮动捕捉能力提出了更高要求。报告期内，本基金维持中性偏高权益中枢，整体来看，本基金多策略框架有效捕捉上半年成长主线行情，报告期净值表现显著跑赢业绩比较基准与沪深 300 指数。

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 2.0921 元，份额累计净值为 2.3583 元，本基金 C 类基金份额净值为 2.0030 元，份额累计净值为 2.2301 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 24.40%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 23.89%，同期业绩基准增长率为 4.18%。

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，A 股市场行情驱动逻辑将由上半年估值扩张逐步转向企业盈利兑现。中长期国内产业升级、高端制造自主可控的大方向不变，但市场仍需持续跟踪三大核心变量：一是 AI 产业落地节奏、企业资本开支与订单兑现情况；二是中东、全球地缘政治局势演变对大宗商品、海外流动性的冲击；三是国内消费、制造业稳增长政策落地效果与内需修复力度。潜在下行风险同样需重点关注：海外货币政策收紧超预期、全球外需持续走弱、科技行业资本开支不及预期、地缘冲突反复扰动风险偏好，均可能影响市场上行空间。

未来本基金将持续运用科学的量化方法，寻找和把握基本面和市场的长期规律，跟踪和捕捉市场各类风格的变化趋势，完善极端情景风控约束，通过多策略分散配置平滑组合波动，力争持续获取稳健超额收益。

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

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：博时量化多策略股票型证券投资基金

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	11,543,267.40	23,887,344.73
结算备付金		40,596,429.66	21,623,029.47
存出保证金		1,949,112.00	1,942,344.00
交易性金融资产	6.4.6.2	243,778,468.51	426,811,030.36
其中：股票投资		242,361,407.20	426,811,030.36
基金投资		-	-
债券投资		1,417,061.31	-
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		1,248,486.70	924,135.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	-	-
资产总计		299,115,764.27	475,187,883.92
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		1,027,519.32	2,448,075.91
应付管理人报酬		283,283.14	438,891.40
应付托管费		47,213.83	73,148.57
应付销售服务费		37,210.00	147,613.39
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.35	19,794.19
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	83,823.01	44,174.62
负债合计		1,479,051.65	3,171,698.08
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	143,515,144.27	286,748,451.36
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	154,121,568.35	185,267,734.48
净资产合计		297,636,712.62	472,016,185.84
负债和净资产总计		299,115,764.27	475,187,883.92

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 143,515,144.27 份。其中 A 类基金份额净值 2.0921 元，基金份额总额 114,247,842.61 份；C 类基金份额净值 2.0030 元，基金份额总额 29,267,301.66 份。

6.2 利润表

会计主体：博时量化多策略股票型证券投资基金

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		73,498,479.02	13,438,849.07
1.利息收入		88,106.73	39,046.14
其中：存款利息收入	6.4.6.9	88,106.73	39,046.14
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）		36,649,885.40	6,344,299.84
其中：股票投资收益	6.4.6.10	33,081,947.38	3,297,567.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.11	3,148.35	11,825.82
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	2,019,041.38	-
股利收益	6.4.6.14	1,545,748.29	3,034,906.41
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	36,373,180.77	6,983,582.92
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	387,306.12	71,920.17
减：二、营业总支出		4,217,568.84	2,036,051.32
1. 管理人报酬		2,851,346.81	1,553,946.78
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		475,224.46	258,991.20
3. 销售服务费		790,113.84	123,424.11
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		9,233.70	-
8. 其他费用	6.4.6.18	91,650.03	99,689.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		69,280,910.18	11,402,797.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		69,280,910.18	11,402,797.75
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		69,280,910.18	11,402,797.75

6.3 净资产变动表

会计主体：博时量化多策略股票型证券投资基金

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	未分配利润	净资产合计

		收益（若有）		
一、上期期末净资产	286,748,451.36	-	185,267,734.48	472,016,185.84
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	286,748,451.36	-	185,267,734.48	472,016,185.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-143,233,307.09	-	-31,146,166.13	-174,379,473.22
（一）、综合收益总额	-	-	69,280,910.18	69,280,910.18
（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）	-143,233,307.09	-	-100,427,076.31	-243,660,383.40
其中：1.基金申购款	142,326,850.98	-	107,295,524.34	249,622,375.32
2.基金赎回款	-285,560,158.07	-	-207,722,600.65	-493,282,758.72
（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	143,515,144.27	-	154,121,568.35	297,636,712.62

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	297,089,166.00	-	74,034,265.37	371,123,431.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	297,089,166.00	-	74,034,265.37	371,123,431.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-123,117,678.46	-	-19,654,610.36	-142,772,288.82
（一）、综合收益总额	-	-	11,402,797.75	11,402,797.75
（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）	-123,117,678.46	-	-31,057,408.11	-154,175,086.57
其中：1.基金申购款	48,270,599.69	-	13,003,826.14	61,274,425.83
2.基金赎回款	-171,388,278.15	-	-44,061,234.25	-215,449,512.40
（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	173,971,487.54	-	54,379,655.01	228,351,142.55

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

博时量化多策略股票型证券投资基金（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[2017]1982 号《关于准予博时量化多策略股票型证券投资基金注册的批复》准予注册，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时量化多策略股票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基金，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 910,902,796.19 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2018）第 0197 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 911,230,422.36 份基金份额，其中认购资金利息折合 327,626.17 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式等不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。在投资者认/申购时收取认/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；在投资者认/申购时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于境内依法发行或上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、权证、股指期货、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债券、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、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、同业存单、债券回购、银行存款、国债

期货和现金，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的规定）。本基金的投资组合比例：股票投资占基金资产的 80%-95%（其中投资于港股通标的股票占股票资产的比例为 0-50%）；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 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。本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部税务总局关于增值税法施

行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

（2）对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

（4）基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

（5）本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	11,543,267.40
等于：本金	11,542,020.69
加：应计利息	1,246.71
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	11,543,267.40

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	193,389,452.12	-	242,361,407.20	48,971,955.08
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所市场	1,401,740.00	16,711.31	1,417,061.31	-1,390.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,401,740.00	16,711.31	1,417,061.31	-1,390.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		194,791,192.12	16,711.31	243,778,468.51	48,970,565.08

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

单位：人民币元

项目	本期末			
	2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	15,824,160.00	-	-	-
---股指期货	15,824,160.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	15,824,160.00	-	-	-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.6.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2607	IF2607	11.00	16,242,600.00	418,440.00
合计	-	-	-	418,440.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	418,440.00
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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	676.28
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	295.45

预提费用	82,851.28
合计	83,823.01

6.4.6.7 实收基金

博时量化多策略股票 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	129,453,489.41	129,453,489.41
本期申购	73,421,305.96	73,421,305.96
本期赎回（以“-”号填列）	-88,626,952.76	-88,626,952.76
本期末	114,247,842.61	114,247,842.61

博时量化多策略股票 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	157,294,961.95	157,294,961.95
本期申购	68,905,545.02	68,905,545.02
本期赎回（以“-”号填列）	-196,933,205.31	-196,933,205.31
本期末	29,267,301.66	29,267,301.66

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

博时量化多策略股票 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	79,181,339.47	9,082,163.82	88,263,503.29
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	79,181,339.47	9,082,163.82	88,263,503.29
本期利润	20,648,767.53	28,788,692.70	49,437,460.23
本期基金份额交易产生的变动数	-13,614,111.26	678,964.62	-12,935,146.64
其中：基金申购款	48,137,442.00	9,902,287.89	58,039,729.89
基金赎回款	-61,751,553.26	-9,223,323.27	-70,974,876.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	86,215,995.74	38,549,821.14	124,765,816.88

博时量化多策略股票 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	86,405,363.09	10,598,868.10	97,004,231.19
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	86,405,363.09	10,598,868.10	97,004,231.19
本期利润	12,258,961.88	7,584,488.07	19,843,449.95
本期基金份额交易产生的变动数	-78,774,100.92	-8,717,828.75	-87,491,929.67
其中：基金申购款	40,765,425.07	8,490,369.38	49,255,794.45
基金赎回款	-119,539,525.99	-17,208,198.13	-136,747,724.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,890,224.05	9,465,527.42	29,355,751.47

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	32,804.87
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	54,150.67
其他	1,151.19
合计	88,106.73

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	1,828,325,128.36
减：卖出股票成本总额	1,792,610,818.67
减：交易费用	2,632,362.31
买卖股票差价收入	33,081,947.38

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	3,431.35
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-283.00
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	3,148.35

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	283.00
买卖债券差价收入	-283.00

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	2,019,041.38

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	1,545,748.29
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	1,545,748.29

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	36,227,072.20
——股票投资	36,228,462.20
——债券投资	-1,390.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	146,108.57
——权证投资	-
——股指期货	146,108.57
4.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	36,373,180.77

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	354,728.13
基金转换费收入	32,577.99
合计	387,306.12

6.4.6.17 信用减值损失

无发生额。

6.4.6.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	5.94
银行汇划费	4,292.81
中债登账户维护费	9,000.00
合计	91,650.03

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

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		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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
招商证券	3,397,628,238.01	100.00%	5,098,263,351.90	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		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	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
招商证券	1,401,740.00	100.00%	4,999,550.00	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	1,499,551.43	100.00%	-	-
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 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	2,252,251.76	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	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	2,851,346.81	1,553,946.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	602,732.78	151,942.60
应支付基金管理人的净管理费	2,248,614.03	1,402,004.18

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 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托管费	475,224.46	258,991.20

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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		
	博时量化多策略股 票 A	博时量化多策略股票 C	合计
招商证券	-	163,015.49	163,015.49
招商银行	-	14,741.47	14,741.47
博时基金	-	441,141.88	441,141.88
合计	-	618,898.84	618,898.84
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		
	博时量化多策略股 票 A	博时量化多策略股票 C	合计
招商证券	-	5,312.55	5,312.55
招商银行	-	847.30	847.30
博时基金	-	5,986.73	5,986.73
合计	-	12,146.58	12,146.58

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 0.80% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

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
招商银行-活期存款	11,543,267.40	32,804.87	6,482,088.34	20,197.88

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	920186	中科仪	北交所网下新股中签	8,880.00	143,944.80

招商证券股份有限公司	001365	天海电子	网下发行	1,665.00	45,271.35
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	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	首次公开发行限售	104.66	768.89	1,131.00	118,370.46	869,614.59	-
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	首次公开发行限售	46.08	463.33	880.00	40,550.40	407,730.40	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	首次公开发行限售	22.68	42.16	5,431.00	123,175.08	228,970.96	-

688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	首次公开发行限售	81.88	1,584.33	135.00	11,053.80	213,884.55	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	首次公开发行限售	19.68	141.49	847.00	16,668.96	119,842.03	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	首次公开发行限售	9.47	70.14	1,463.00	13,854.61	102,614.82	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	首次公开发行限售	10.11	10.11	8,753.00	88,492.83	88,492.83	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	首次公开发行限售	69.66	160.06	551.00	38,382.66	88,193.06	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	首次公开发行限售	44.56	468.67	123.00	5,480.88	57,646.41	-
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	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	首次公开发行限售	10.12	27.73	1,544.00	15,625.28	42,815.12	-
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	2026-05-20	6 个月	首次公开发行	40.98	308.19	128.00	5,245.44	39,448.32	-

	子			限售						
001248	华 润 新 能 源	2026-06-24	6 个 交易 日	新股 未上 市	10.11	10.11	3,750.00	37,912.50	37,912.50	-
001257	盛 龙 股 份	2026-03-24	6 个 月	首次 公开发 行 限售	7.82	20.74	1,743.00	13,630.26	36,149.82	-
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	-
688811	有 研 复 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	-
001365	天 海 电 子	2026-05-11	6 个 月	首次 公开发 行 限售	27.19	31.31	500.00	13,595.00	15,655.00	-
301669	高 特 电 子	2026-06-02	6 个 月	首次 公开发 行 限售	7.08	28.40	546.00	3,865.68	15,506.40	-
301687	新 广 益	2025-12-24	6 个 月	首次 公开发 行 限售	21.93	77.78	195.00	4,276.35	15,167.10	-
301531	春 光 集 团	2026-04-28	6 个 月	首次 公开发 行 限售	13.30	51.56	290.00	3,857.00	14,952.40	-
301599	理 奇 智 能	2026-04-22	6 个 月	首次 公开发 行 限售	13.91	32.47	433.00	6,023.03	14,059.51	-
001393	维 通	2026-05-08	6 个 月	首次公开	30.38	38.99	356.00	10,815.28	13,880.44	-

	利			发行 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	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	首次公开发 行限售	53.26	58.74	192.00	10,225.92	11,278.08	-
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	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	首次公开发 行限售	11.18	17.59	444.00	4,963.92	7,809.96	-
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	-
920136	永励精密	2026-06-25	10 个交易 日	新股未上 市	19.28	19.28	300.00	5,784.00	5,784.00	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	首次公开发 行限售	15.76	46.71	104.00	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	首次公开发 行限售	21.88	25.52	112.00	2,450.56	2,858.24	-
920193	吉和	2026-06-18	9 个交易 日	新股未上 市	8.52	8.52	300.00	2,556.00	2,556.00	-

	昌		日	市						
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	首次公开发行限售	33.49	33.93	72.00	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	首次公开发行限售	18.38	16.78	134.00	2,462.92	2,248.52	-
920189	康美特	2026-06-30	6 个交易日	新股未上市	8.14	8.14	200.00	1,628.00	1,628.00	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	首次公开发行限售	37.88	34.87	46.00	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	首次公开发行限售	28.00	27.78	57.00	1,596.00	1,583.46	-

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	2,750.00	1,493,872.78	2,288,000.00	-
--------	------	------------	--------	--------	------------	--------	----------	--------------	--------------	---

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

本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。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，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金运用科学的量化方法，把握市场规律，跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势，并针对当前市场风格特点，选择因子和构建策略组合，力求获取长期相对市场的超额收益。

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，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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	1,417,061.31	-
合计	1,417,061.31	-

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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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	11,543,267.40	-	-	-	11,543,267.40
结算备付金	40,596,429.66	-	-	-	40,596,429.66
存出保证金	-	-	-	1,949,112.00	1,949,112.00
交易性金融资产	1,417,061.31	-	-	-242,361,407.20	243,778,468.51
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,248,486.70	1,248,486.70
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	53,556,758.37	-	-	-245,559,005.90	299,115,764.27
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,027,519.32	1,027,519.32
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	283,283.14	283,283.14
应付托管费	-	-	-	47,213.83	47,213.83
应付销售服务费	-	-	-	37,210.00	37,210.00
应交税费	-	-	-	2.35	2.35
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	83,823.01	83,823.01
负债总计	-	-	-	1,479,051.65	1,479,051.65
利率敏感度缺口	53,556,758.37	-	-	-244,079,954.25	297,636,712.62
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	23,887,344.73	-	-	-	23,887,344.73
结算备付金	21,623,029.47	-	-	-	21,623,029.47
存出保证金	-	-	-	1,942,344.00	1,942,344.00
交易性金融资产	-	-	-	-426,811,030.36	426,811,030.36
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	924,135.36	924,135.36
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	45,510,374.20	-	-	-429,677,509.72	475,187,883.92
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	2,448,075.91	2,448,075.91
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	438,891.40	438,891.40
应付托管费	-	-	-	73,148.57	73,148.57
应付销售服务费	-	-	-	147,613.39	147,613.39
应交税费	-	-	-	19,794.19	19,794.19
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	44,174.62	44,174.62
负债总计	-	-	-	3,171,698.08	3,171,698.08
利率敏感度缺口	45,510,374.20	-	-	-426,505,811.64	472,016,185.84

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 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.上年度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	-	155,296.74	155,296.74
资产合计	-	155,296.74	155,296.74
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	-	155,296.74	155,296.74
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	-	129,070.14	129,070.14
资产合计	-	129,070.14	129,070.14
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	-	129,070.14	129,070.14

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
	2.所有港币均相对人民币贬值 5%	减少约 1	减少约 1

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	242,361,407.20	81.43	426,811,030.36	90.42
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	242,361,407.20	81.43	426,811,030.36	90.42

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 1,813	增加约 2,905
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,813	减少约 2,905

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	237,339,630.74
第二层次	3,841,434.64
第三层次	2,597,403.13
合计	243,778,468.51

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	242,361,407.20	81.03
	其中：股票	242,361,407.20	81.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,417,061.31	0.47
	其中：债券	1,417,061.31	0.47
	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	52,139,697.06	17.43
8	其他各项资产	3,197,598.70	1.07
9	合计	299,115,764.27	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 155,296.74 元，净值占比 0.05%。

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	246,780.00	0.08
B	采矿业	3,719,898.58	1.25
C	制造业	198,788,624.11	66.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,735,339.33	1.25
E	建筑业	68,250.00	0.02

F	批发和零售业	12,423,331.00	4.17
G	交通运输、仓储和邮政业	4,699,611.04	1.58
H	住宿和餐饮业	28,636.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,641,003.00	1.56
J	金融业	7,207,566.40	2.42
K	房地产业	109,560.00	0.04
L	租赁和商务服务业	214,229.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	6,117,591.00	2.06
N	水利、环境和公共设施管理业	111,204.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	64,763.00	0.02
Q	卫生和社会工作	14,980.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	14,744.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	242,206,110.46	81.38

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	155,296.74	0.05
合计	155,296.74	0.05

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	300308	中际旭创	8,000	10,160,000.00	3.41
2	688037	芯源微	21,146	9,284,151.30	3.12
3	603986	兆易创新	10,500	8,557,500.00	2.88
4	300604	长川科技	23,800	8,125,796.00	2.73
5	688257	新锐股份	74,620	7,603,778.00	2.55
6	688498	源杰科技	4,000	7,544,000.00	2.53
7	688059	华锐精密	36,900	7,369,299.00	2.48

8	001309	德明利	7,800	7,354,620.00	2.47
9	300475	香农芯创	24,500	7,350,000.00	2.47
10	688002	睿创微纳	45,500	7,038,395.00	2.36
11	300223	北京君正	27,800	6,919,420.00	2.32
12	688090	瑞松科技	64,480	6,863,896.00	2.31
13	300857	协创数据	19,840	6,743,616.00	2.27
14	301308	江波龙	8,500	5,982,300.00	2.01
15	603259	药明康德	47,700	5,939,127.00	2.00
16	601198	东兴证券	386,400	5,251,176.00	1.76
17	002008	大族激光	30,800	4,623,388.00	1.55
18	600233	圆通速递	278,900	4,392,675.00	1.48
19	300972	万辰集团	25,300	4,387,273.00	1.47
20	688308	欧科亿	24,100	4,381,621.00	1.47
21	300590	移为通信	275,600	3,954,860.00	1.33
22	601233	桐昆股份	179,200	3,879,680.00	1.30
23	002371	北方华创	4,300	3,803,608.00	1.28
24	000703	恒逸石化	269,100	3,651,687.00	1.23
25	002493	荣盛石化	336,000	3,612,000.00	1.21
26	000685	中山公用	315,200	3,517,632.00	1.18
27	603317	天味食品	268,200	3,489,282.00	1.17
28	000807	云铝股份	155,300	3,438,342.00	1.16
29	301536	星辰科技	25,700	3,307,847.00	1.11
30	600150	中国船舶	96,100	3,247,219.00	1.09
31	600595	中孚实业	535,700	3,010,634.00	1.01
32	301377	鼎泰高科	4,800	2,644,320.00	0.89
33	300502	新易盛	3,820	2,318,740.00	0.78
34	688072	拓荆科技	2,750	2,288,000.00	0.77
35	603345	安井食品	27,300	2,189,187.00	0.74
36	000426	兴业银锡	56,200	1,852,352.00	0.62
37	300750	宁德时代	4,700	1,847,147.00	0.62
38	688409	富创精密	5,550	1,699,687.50	0.57
39	688525	佰维存储	3,400	1,682,082.00	0.57
40	600489	中金黄金	91,300	1,647,965.00	0.55
41	688120	华海清科	5,100	1,643,118.00	0.55
42	603061	金海通	3,200	1,607,104.00	0.54
43	688266	泽璟制药	13,250	1,545,745.00	0.52
44	688652	京仪装备	7,650	1,531,300.50	0.51
45	688012	中微公司	3,200	1,499,200.00	0.50
46	688200	华峰测控	2,750	1,444,025.00	0.49
47	003043	华亚智能	14,300	1,421,277.00	0.48
48	688605	先锋精科	13,650	1,419,873.00	0.48
49	301358	湖南裕能	18,500	1,403,595.00	0.47
50	603203	快克智能	17,800	1,366,684.00	0.46

51	688627	精智达	1,900	1,358,500.00	0.46
52	300316	晶盛机电	21,900	1,322,760.00	0.44
53	688729	屹唐股份	30,748	1,322,164.00	0.44
54	688630	芯碁微装	2,400	1,318,536.00	0.44
55	301369	联动科技	5,300	1,298,500.00	0.44
56	688661	和林微纳	8,150	1,295,687.00	0.44
57	688256	寒武纪	800	1,276,440.00	0.43
58	002558	巨人网络	45,300	1,248,468.00	0.42
59	605117	德业股份	10,740	1,140,373.20	0.38
60	300438	鹏辉能源	13,700	1,135,045.00	0.38
61	002460	赣锋锂业	16,100	1,052,940.00	0.35
62	600499	科达制造	75,800	1,046,040.00	0.35
63	688802	沐曦股份	1,131	869,614.59	0.29
64	603093	南华期货	41,100	745,965.00	0.25
65	688111	金山办公	3,400	724,370.00	0.24
66	002414	高德红外	50,000	663,000.00	0.22
67	688045	必易微	6,400	516,992.00	0.17
68	002645	华宏科技	15,440	424,754.40	0.14
69	688291	金橙子	7,200	421,056.00	0.14
70	688221	前沿生物	18,500	414,400.00	0.14
71	601939	建设银行	42,500	409,275.00	0.14
72	301666	大普微	880	407,730.40	0.14
73	301217	铜冠铜箔	2,300	379,661.00	0.13
74	001339	智微智能	3,640	372,299.20	0.13
75	688503	聚和材料	2,750	364,925.00	0.12
76	002709	天赐材料	7,000	360,010.00	0.12
77	603690	至纯科技	10,100	357,540.00	0.12
78	002956	西麦食品	16,380	340,048.80	0.11
79	601077	渝农商行	55,500	339,105.00	0.11
80	600919	江苏银行	30,630	330,191.40	0.11
81	688008	澜起科技	1,000	309,900.00	0.10
82	002154	报喜鸟	86,400	307,584.00	0.10
83	601717	中创智领	20,000	278,200.00	0.09
84	920394	民士达	3,900	268,905.00	0.09
85	300970	华绿生物	13,500	246,780.00	0.08
86	920571	国航远洋	28,494	229,946.58	0.08
87	688781	视涯科技	5,431	228,970.96	0.08
88	920821	则成电子	10,981	218,631.71	0.07
89	688808	联讯仪器	135	213,884.55	0.07
90	920720	吉冈精密	19,984	199,440.32	0.07
91	920418	苏轴股份	9,075	180,592.50	0.06
92	920510	丰光精密	7,169	173,346.42	0.06
93	920576	天力复合	2,800	173,040.00	0.06

94	920060	万源通	6,200	161,882.00	0.05
95	00981	中芯国际	2,000	155,296.74	0.05
96	920592	华信永道	6,600	150,480.00	0.05
97	920002	万达轴承	2,921	146,897.09	0.05
98	001248	华润新能源	12,503	126,405.33	0.04
99	920047	诺思兰德	6,100	125,355.00	0.04
100	601168	西部矿业	4,584	124,409.76	0.04
101	688820	盛合晶微	847	119,842.03	0.04
102	920029	开发科技	3,441	117,269.28	0.04
103	688818	电科蓝天	1,463	102,614.82	0.03
104	920522	纳科诺尔	3,960	93,852.00	0.03
105	300650	太龙股份	6,300	91,539.00	0.03
106	301682	宏明电子	551	88,193.06	0.03
107	600177	雅戈尔	11,500	86,595.00	0.03
108	605300	佳禾食品	8,000	78,000.00	0.03
109	688809	强一股份	124	77,252.00	0.03
110	920077	吉林碳谷	4,200	74,508.00	0.03
111	002293	罗莱生活	7,400	73,186.00	0.02
112	603928	兴业股份	4,860	71,928.00	0.02
113	920735	德源药业	2,990	71,341.40	0.02
114	688328	深科达	700	66,990.00	0.02
115	300434	金石亚药	5,900	66,257.00	0.02
116	920106	林泰新材	1,750	65,450.00	0.02
117	605151	西上海	3,600	63,396.00	0.02
118	002966	苏州银行	8,700	60,552.00	0.02
119	600546	山煤国际	5,400	59,022.00	0.02
120	688797	臻宝科技	123	57,646.41	0.02
121	601963	重庆银行	5,700	57,456.00	0.02
122	300404	博济医药	6,400	56,064.00	0.02
123	002271	东方雨虹	4,700	55,789.00	0.02
124	002646	天佑德酒	8,800	55,528.00	0.02
125	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.02
126	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.02
127	603719	良品铺子	6,200	53,630.00	0.02
128	000565	渝三峡 A	9,400	53,392.00	0.02
129	000419	通程控股	11,800	53,218.00	0.02
130	300583	赛托生物	4,700	52,781.00	0.02
131	002148	北纬科技	9,000	52,290.00	0.02
131	300030	阳普医疗	9,000	52,290.00	0.02
132	301116	益客食品	6,100	52,216.00	0.02
133	002702	海欣食品	11,700	52,065.00	0.02
134	002494	华斯股份	11,700	51,948.00	0.02
135	300694	蠡湖股份	5,400	51,840.00	0.02

136	301370	国科恒泰	6,400	51,776.00	0.02
137	603066	音飞储存	5,300	51,728.00	0.02
138	300575	中旗股份	10,500	51,660.00	0.02
139	600712	南宁百货	11,200	51,520.00	0.02
140	003016	欣贺股份	8,400	51,492.00	0.02
141	300915	海融科技	2,600	51,480.00	0.02
142	603506	南都物业	5,500	51,370.00	0.02
143	603900	莱绅通灵	9,100	51,233.00	0.02
144	600356	恒丰纸业	6,900	51,129.00	0.02
145	603630	拉芳家化	4,000	51,120.00	0.02
146	600768	宁波富邦	3,400	50,932.00	0.02
147	605138	盛泰集团	9,200	50,784.00	0.02
148	002593	日上集团	12,700	50,673.00	0.02
149	603696	安记食品	4,400	50,600.00	0.02
150	301136	招标股份	4,600	50,508.00	0.02
151	600661	昂立教育	7,300	50,443.00	0.02
152	600128	苏豪弘业	6,600	50,094.00	0.02
153	605136	丽人丽妆	7,000	49,910.00	0.02
154	002574	明牌珠宝	12,000	49,800.00	0.02
155	002780	三夫户外	4,100	49,774.00	0.02
156	300823	建科智能	3,400	49,572.00	0.02
157	600148	长春一东	3,400	49,334.00	0.02
158	300662	科锐国际	2,900	49,242.00	0.02
159	688699	明微电子	600	49,170.00	0.02
160	300213	佳讯飞鸿	8,100	49,086.00	0.02
161	300771	智莱科技	4,700	48,504.00	0.02
162	603365	水星家纺	3,100	48,267.00	0.02
163	688653	康希通信	2,600	45,188.00	0.02
164	001218	丽臣实业	2,000	44,120.00	0.01
165	002079	苏州固锔	2,900	43,587.00	0.01
166	001399	惠科股份	1,544	42,815.12	0.01
167	600282	南钢股份	9,100	41,769.00	0.01
168	920368	连城数控	1,400	40,894.00	0.01
169	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
170	300016	北陆药业	5,200	39,884.00	0.01
171	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
172	002563	森马服饰	7,800	39,312.00	0.01
173	002345	潮宏基	4,200	38,514.00	0.01
174	002365	永安药业	3,800	38,456.00	0.01
175	002027	分众传媒	7,800	37,752.00	0.01
176	688285	高铁电气	5,252	37,656.84	0.01
177	688580	伟思医疗	700	37,289.00	0.01
178	600037	歌华有线	5,900	36,993.00	0.01

179	600833	第一医药	4,100	36,982.00	0.01
180	002111	威海广泰	4,100	36,900.00	0.01
181	002573	清新环境	12,500	36,750.00	0.01
182	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
183	603711	香飘飘	3,200	35,552.00	0.01
184	603697	有友食品	3,700	35,483.00	0.01
185	300971	博亚精工	1,900	35,454.00	0.01
186	603030	全筑股份	17,600	35,024.00	0.01
187	688269	凯立新材	1,100	34,881.00	0.01
188	600057	厦门象屿	6,400	34,688.00	0.01
189	002115	三维通信	3,300	33,990.00	0.01
190	002043	兔宝宝	3,000	33,240.00	0.01
191	301487	盟固利	1,700	32,555.00	0.01
192	603459	红板科技	330	27,825.60	0.01
193	603276	恒兴新材	1,580	24,189.80	0.01
194	002582	好想你	2,700	22,815.00	0.01
195	688811	有研新材	834	20,124.42	0.01
196	300406	九强生物	1,800	19,674.00	0.01
197	301043	绿岛风	400	19,644.00	0.01
198	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.01
199	002628	成都路桥	3,500	18,725.00	0.01
200	688589	力合微	800	18,384.00	0.01
201	603558	健盛集团	1,600	17,744.00	0.01
202	000812	陕西金叶	5,500	17,050.00	0.01
203	002259	升达林业	4,400	16,676.00	0.01
204	600824	益民集团	5,000	16,450.00	0.01
205	300062	中能电气	2,900	16,269.00	0.01
206	002330	得利斯	4,700	16,262.00	0.01
207	300299	富春股份	3,300	16,170.00	0.01
208	002616	长青集团	3,600	16,092.00	0.01
209	002923	润都股份	1,700	16,082.00	0.01
210	603291	联合水务	2,000	16,080.00	0.01
211	002162	悦心健康	4,700	15,886.00	0.01
212	601366	利群股份	4,900	15,827.00	0.01
213	300824	北鼎股份	2,200	15,796.00	0.01
214	002347	泰尔股份	2,700	15,795.00	0.01
215	688247	宣泰医药	2,100	15,792.00	0.01
216	300800	力合科技	1,700	15,725.00	0.01
217	300512	中亚股份	2,300	15,686.00	0.01
218	001365	天海电子	500	15,655.00	0.01
219	301355	南王科技	1,600	15,648.00	0.01
220	300549	优德精密	1,200	15,624.00	0.01
221	301311	昆船智能	1,200	15,588.00	0.01

222	601339	百隆东方	2,300	15,571.00	0.01
223	002889	东方嘉盛	1,500	15,540.00	0.01
224	301669	高特电子	546	15,506.40	0.01
225	300350	华鹏飞	3,900	15,483.00	0.01
226	600858	银座股份	3,500	15,435.00	0.01
227	300908	仲景食品	700	15,428.00	0.01
228	300519	新光药业	1,300	15,405.00	0.01
229	603797	联泰环保	4,100	15,375.00	0.01
230	300642	透景生命	1,300	15,340.00	0.01
231	002094	青岛金王	3,500	15,330.00	0.01
232	002722	物产金轮	1,300	15,327.00	0.01
233	002105	信隆健康	3,100	15,314.00	0.01
234	300510	金冠股份	4,900	15,288.00	0.01
235	300172	中电环保	3,700	15,281.00	0.01
236	002817	黄山胶囊	2,600	15,236.00	0.01
237	301082	久盛电气	1,700	15,232.00	0.01
238	002968	新大正	1,800	15,228.00	0.01
239	301687	新广益	195	15,167.10	0.01
240	300753	爱朋医疗	800	15,144.00	0.01
241	000906	浙商中拓	3,000	15,120.00	0.01
242	301066	万事利	1,300	15,093.00	0.01
243	300830	金现代	1,900	15,086.00	0.01
244	002337	赛象科技	3,400	15,062.00	0.01
245	300732	设研院	2,700	15,039.00	0.01
246	002666	德联集团	3,800	15,010.00	0.01
247	002398	垒知集团	4,000	15,000.00	0.01
248	603739	蔚蓝生物	1,300	14,989.00	0.01
249	301103	何氏眼科	1,000	14,980.00	0.01
250	605033	美邦股份	900	14,976.00	0.01
251	300074	华平股份	4,400	14,960.00	0.01
252	301531	春光集团	290	14,952.40	0.01
253	000421	南京公用	3,000	14,880.00	0.00
253	603280	南方路机	600	14,880.00	0.00
254	300597	吉大通信	2,100	14,868.00	0.00
255	600202	哈空调	3,300	14,784.00	0.00
256	300987	川网传媒	1,200	14,760.00	0.00
257	301025	读客文化	1,900	14,744.00	0.00
258	688058	宝兰德	700	14,644.00	0.00
258	688370	从麟科技	700	14,644.00	0.00
259	603385	惠达卫浴	3,000	14,640.00	0.00
260	600616	金枫酒业	3,900	14,625.00	0.00
261	300425	中建环能	3,900	14,586.00	0.00
262	600697	欧亚集团	1,500	14,580.00	0.00

263	002133	广宇集团	6,100	14,579.00	0.00
264	301073	君亭酒店	800	14,560.00	0.00
265	603689	皖天然气	2,100	14,553.00	0.00
266	301126	达嘉维康	1,700	14,535.00	0.00
267	603860	中公高科	600	14,514.00	0.00
268	603909	建发合诚	1,700	14,501.00	0.00
269	301505	苏州规划	900	14,490.00	0.00
270	301083	百胜智能	1,100	14,487.00	0.00
271	600218	全柴动力	2,000	14,440.00	0.00
272	600638	新黄浦	3,300	14,421.00	0.00
273	002863	今飞凯达	3,400	14,416.00	0.00
274	001368	通达创智	700	14,399.00	0.00
275	002136	安纳达	1,100	14,388.00	0.00
276	603022	新通联	1,800	14,382.00	0.00
276	605567	春雪食品	1,800	14,382.00	0.00
277	002942	新农股份	1,000	14,330.00	0.00
278	300414	中光防雷	1,300	14,326.00	0.00
279	300359	全通教育	4,000	14,320.00	0.00
280	603518	锦泓集团	2,000	14,300.00	0.00
281	603045	福达合金	200	14,278.00	0.00
282	301019	宁波色母	800	14,264.00	0.00
283	688244	永信至诚	1,000	14,260.00	0.00
284	000803	山高环能	2,100	14,238.00	0.00
285	300112	万讯自控	2,300	14,237.00	0.00
286	300691	联合光电	900	14,229.00	0.00
287	300675	建科院	1,200	14,220.00	0.00
288	300789	唐源电气	800	14,216.00	0.00
289	301278	快可电子	500	14,200.00	0.00
290	603600	永艺股份	1,600	14,192.00	0.00
291	300645	正元智慧	1,200	14,124.00	0.00
292	000607	华媒控股	4,600	14,122.00	0.00
293	301519	舜禹股份	1,300	14,105.00	0.00
294	301429	森泰股份	900	14,103.00	0.00
295	300141	和顺电气	1,500	14,085.00	0.00
296	300945	曼卡龙	1,300	14,079.00	0.00
297	002186	全聚德	1,700	14,076.00	0.00
298	600051	宁波联合	2,500	14,075.00	0.00
299	603029	天鹅股份	1,000	14,060.00	0.00
300	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
301	002187	广百股份	3,000	14,040.00	0.00
301	300822	贝仕达克	1,200	14,040.00	0.00
301	600738	丽尚国潮	3,900	14,040.00	0.00
302	301388	欣灵电气	600	13,992.00	0.00

303	300933	中辰股份	2,300	13,984.00	0.00
304	000514	渝开发	3,900	13,962.00	0.00
305	001393	维通利	356	13,880.44	0.00
306	600318	新力金融	2,300	13,846.00	0.00
307	603706	东方环宇	800	13,832.00	0.00
308	300805	电声股份	1,900	13,775.00	0.00
309	301167	建研设计	1,100	13,629.00	0.00
310	603190	亚通精工	600	13,572.00	0.00
310	603390	通达电气	1,300	13,572.00	0.00
311	301456	盘古智能	600	13,548.00	0.00
312	603051	鹿山新材	700	13,496.00	0.00
313	603041	美思德	1,300	13,481.00	0.00
314	301113	雅艺科技	900	13,419.00	0.00
315	300701	森霸传感	1,400	13,398.00	0.00
316	002451	摩恩电气	1,900	13,376.00	0.00
317	300417	南华仪器	1,300	13,338.00	0.00
318	603214	爱婴室	1,100	13,321.00	0.00
319	600560	金自天正	1,200	13,296.00	0.00
320	301353	普莱得	800	13,288.00	0.00
321	603918	金桥信息	1,400	13,272.00	0.00
322	605189	富春染织	1,100	13,255.00	0.00
323	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
324	002037	保利联合	2,100	13,104.00	0.00
325	300927	江天化学	600	12,918.00	0.00
326	002184	海得控制	1,400	12,824.00	0.00
326	301190	善水科技	800	12,824.00	0.00
327	002054	德美化工	1,900	12,635.00	0.00
328	300658	延江股份	1,100	12,573.00	0.00
329	301032	新柴股份	1,300	12,090.00	0.00
330	301068	大地海洋	500	11,900.00	0.00
331	688633	星球石墨	400	11,892.00	0.00
332	300837	浙矿股份	500	11,880.00	0.00
333	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
334	301057	汇隆新材	500	11,500.00	0.00
335	001237	惠康科技	192	11,278.08	0.00
336	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
337	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
338	002040	南京港	1,100	8,195.00	0.00
339	601112	振石股份	444	7,809.96	0.00
340	301210	金杨精密	260	7,800.00	0.00
341	600329	达仁堂	200	7,444.00	0.00
342	002090	金智科技	800	7,072.00	0.00
343	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00

344	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
345	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
346	300884	狄耐克	300	2,976.00	0.00
347	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
348	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
349	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
350	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
351	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
352	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
353	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
354	601798	蓝科高新	200	1,448.00	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	601198	东兴证券	18,275,403.00	3.87
2	601995	中金公司	16,541,225.00	3.50
3	601398	工商银行	12,055,773.00	2.55
4	601328	交通银行	11,927,989.00	2.53
5	688257	新锐股份	10,571,441.24	2.24
6	603799	华友钴业	9,767,272.00	2.07
7	601899	紫金矿业	9,654,723.00	2.05
8	002345	潮宏基	9,516,549.00	2.02
9	688059	华锐精密	9,153,453.81	1.94
10	603259	药明康德	8,990,313.00	1.90
11	603986	兆易创新	8,766,610.00	1.86
12	603059	倍加洁	8,675,682.00	1.84
13	601988	中国银行	8,454,411.00	1.79
14	300857	协创数据	8,376,874.00	1.77
15	300604	长川科技	8,282,920.00	1.75
16	300308	中际旭创	8,231,109.00	1.74
17	300475	香农芯创	8,091,423.00	1.71
18	688525	佰维存储	8,052,941.01	1.71
19	601857	中国石油	7,976,740.00	1.69
20	603588	高能环境	7,965,605.80	1.69

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	601198	东兴证券	17,648,585.00	3.74
2	601995	中金公司	16,344,087.00	3.46
3	601398	工商银行	14,143,049.00	3.00
4	603993	洛阳钼业	13,426,152.00	2.84
5	601328	交通银行	13,141,710.00	2.78
6	603259	药明康德	12,953,299.00	2.74
7	002028	思源电气	12,732,693.00	2.70
8	601318	中国平安	11,522,639.84	2.44
9	300604	长川科技	11,138,171.00	2.36
10	688498	源杰科技	10,804,964.08	2.29
11	300750	宁德时代	10,386,969.00	2.20
12	601988	中国银行	10,300,669.00	2.18
13	002916	深南电路	10,217,634.40	2.16
14	688525	佰维存储	10,135,389.05	2.15
15	605098	行动教育	9,614,597.08	2.04
16	600183	生益科技	9,506,555.00	2.01
17	301200	大族数控	9,040,248.00	1.92
18	603588	高能环境	8,969,325.68	1.90
19	300953	震裕科技	8,910,825.60	1.89
20	301031	中熔电气	8,814,785.00	1.87

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	1,571,932,733.31
卖出股票的收入（成交）总额	1,828,325,128.36

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	1,417,061.31	0.48

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	1,417,061.31	0.48

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	019785	25 国债 13	13,000	1,316,413.12	0.44
2	019827	26 国债 01	1,000	100,648.19	0.03

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

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	1,949,112.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,248,486.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,197,598.70

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	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时量化多策略股票 A	3,342	34,185.47	78,455,816.86	68.67%	35,792,025.75	31.33%
博时量化多策略股票 C	1,809	16,178.72	2,505,109.53	8.56%	26,762,192.13	91.44%
合计	5,065	28,334.68	80,960,926.39	56.41%	62,554,217.88	43.59%

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	70.26%

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	博时量化多策略股票 A	307,798.77	0.27%
	博时量化多策略股票 C	172.33	0.00%
	合计	307,971.10	0.21%

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	博时量化多策略股票 A	-
	博时量化多策略股票 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时量化多策略股票 A	0~10
	博时量化多策略股票 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	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
基金合同生效日(2018 年 4 月 3 日) 基金份额总额	146,135,440.46	765,094,981.90
本报告期期初基金份额总额	129,453,489.41	157,294,961.95
本报告期基金总申购份额	73,421,305.96	68,905,545.02
减：本报告期基金总赎回份额	88,626,952.76	196,933,205.31
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	114,247,842.61	29,267,301.66

§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。

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 年起改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人没有受到监管部门的调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员没有受到监管部门的调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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	
西部证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	9	3,397,628,238.01	100.00%	1,499,551.43	100.00%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-

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
西部证券	-	-	-	-	-	-

招商证券	1,401,740.00	100.00%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-

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	博时量化多策略股票型证券投资基金（博时量化多策略股票 C）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-26
2	博时量化多策略股票型证券投资基金（博时量化多策略股票 A）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-26
3	博时基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-05-29
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-05-13
5	2025 年度博时基金以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-30
6	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-24
7	博时量化多策略股票型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-22
8	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31
9	博时量化多策略股票型证券投资基金 2025 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31
10	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-26

11	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-14
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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-24
13	博时量化多策略股票型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-22

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026-06-23~2026-06-30	28,921,037.86	-	-	28,921,037.86	20.15%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

注：1.申购份额包含红利再投资份额。

2.份额占比为四舍五入后的结果。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时量化多策略股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时量化多策略股票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、博时量化多策略股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时量化多策略股票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