

博时上证科创板综合价格指数增强型证

券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
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）	13
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	51
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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51

7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	53
§9 开放式基金份额变动	53
§10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
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	55
10.8 其他重大事件	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金	
基金简称	博时上证科创板综合价格指数增强	
基金主代码	023891	
交易代码	023891	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 4 月 29 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	24,723,405.86 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时上证科创板综合价格指数增强 A	博时上证科创板综合价格指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023891	023892
报告期末下属分级基金的份额总额	15,548,187.46 份	9,175,218.40 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化方法进行组合管理和风险控制，在力求对标的指数上证科创板综合价格指数有效跟踪的基础上，力争实现超越基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.50%，年跟踪误差不超过 7.5%。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。本基金主要通过博时数量化模型对股票进行综合评定，结合风险控制模型，在控制投资组合风险预算下，对股票组合进行优化，力争获得超越业绩比较基准的回报。基金管理人借鉴国际定量分析的经验，以对中国市场的长期研究为

	基础，综合来自公司财务报表、分析师预测和市场行情趋势等方面的信息，构建博时数量化模型。该模型从价值、成长、盈利、质量、行情趋势等方面，从长期和短期角度，对股票进行综合评估，得到股票未来回报能力的判断。投资经理以数量化模型为基础，根据自身经验对市场状况作出前瞻性判断，优化投资组合。基金管理人将根据历史回测数据和市场状况，对博时数量化模型进行检验和改进，力争保持模型的有效和稳定，为投资决策提供支持。本基金的其他投资策略还包括港股投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	上证科创板综合价格指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为股票型指数增强基金，跟踪上证科创板综合价格指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	任航
	联系电话	0755-83169999	010-66060069
	电子邮箱	service@bosera.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105568	95599
传真		0755-83195140	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		张东	谷澍

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）	
	博时上证科创板综合价格指数增强 A	博时上证科创板综合价格指数增强 C
本期已实现收益	3,768,176.98	2,205,604.07
本期利润	11,763,688.25	6,704,972.30
加权平均基金份额本期利润	0.6152	0.5833
本期加权平均净值利润率	40.34%	38.49%
本期基金份额净值增长率	49.07%	48.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	博时上证科创板综合价格指数增强 A	博时上证科创板综合价格指数增强 C
期末可供分配利润	8,324,958.47	4,844,712.41
期末可供分配基金份额利润	0.5354	0.5280
期末基金资产净值	31,226,227.60	18,341,134.41

期末基金份额净值	2.0084	1.9990
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	博时上证科创板综合价格指数增强 A	博时上证科创板综合价格指数增强 C
基金份额累计净值增长率	100.84%	99.90%

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

博时上证科创板综合价格指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	51.18%	2.22%	52.19%	2.24%	-1.01%	-0.02%
过去六个月	49.07%	2.09%	50.66%	2.11%	-1.59%	-0.02%
过去一年	96.25%	1.81%	97.51%	1.86%	-1.26%	-0.05%
自基金合同生效起至今	100.84%	1.71%	108.36%	1.76%	-7.52%	-0.05%

博时上证科创板综合价格指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	51.03%	2.22%	52.19%	2.24%	-1.16%	-0.02%
过去六个月	48.78%	2.09%	50.66%	2.11%	-1.88%	-0.02%
过去一年	95.48%	1.81%	97.51%	1.86%	-2.03%	-0.05%
自基金合同生效起至今	99.90%	1.71%	108.36%	1.76%	-8.46%	-0.05%

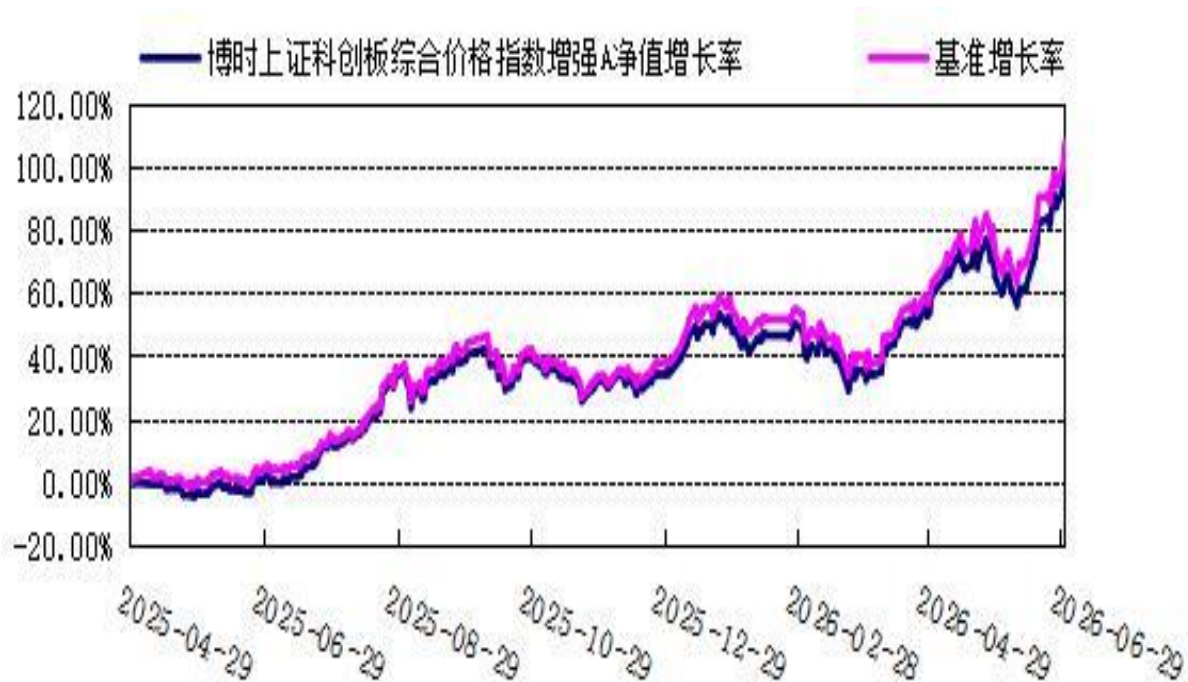
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金

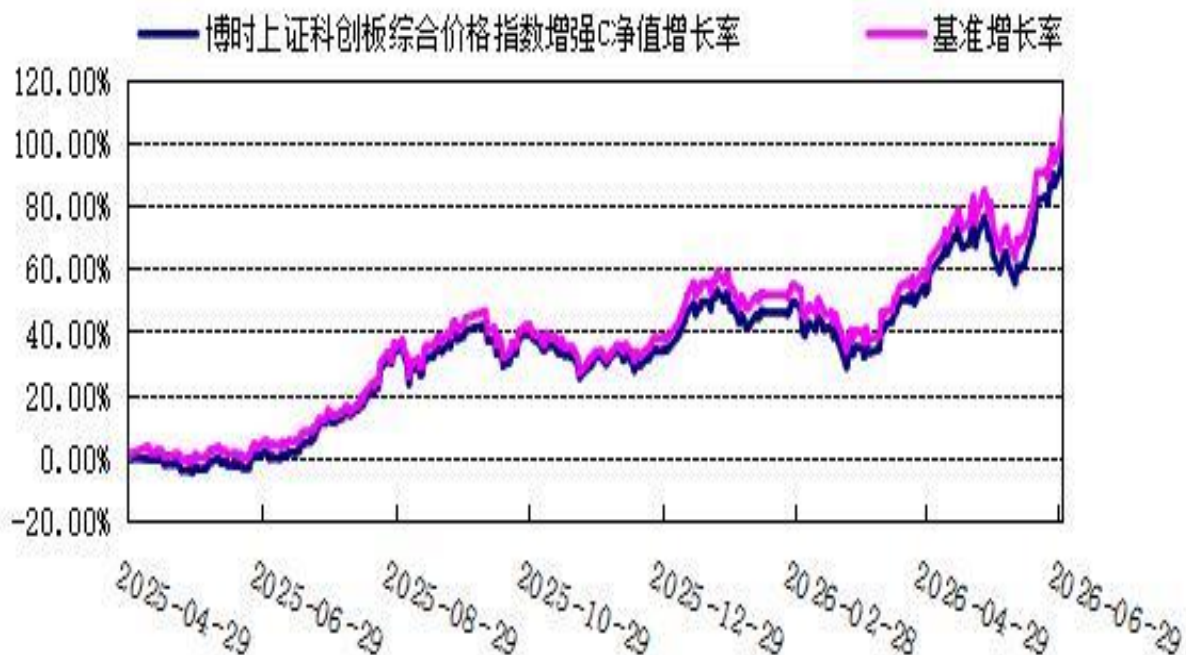
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2025 年 4 月 29 日至 2026 年 6 月 30 日)

博时上证科创板综合价格指数增强 A



博时上证科创板综合价格指数增强 C



注：本基金的基金合同于 2025 年 4 月 29 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助	证券从业	说明
----	----	-------------	------	----

		理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
刘玉强	基金经理	2025-04-29	-	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，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。

本基金为科创综合价格指数增强基金，以跟踪上证科创板综合价格指数为基础目标，依托动态多因子量化模型开展增强选股，投资聚焦科创板高新技术企业。上半年科创成长单边走强、板块波动放大，对模型跟踪误差控制提出较高要求。报告期内基金均衡配置多因子，分阶段调整科创景气因子权重，严格约束风格暴露与风险预算，在贴合指数走势的基础上捕捉科创产业超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 2.0084 元，份额累计净值为 2.0084 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.9990 元，份额累计净值为 1.9990 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 49.07%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 48.78%，同期业绩基准增长率为 50.66%。

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。潜在下行风险同样不容忽视：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。

未来本基金将持续优化科创专属多因子模型，一方面严格控制跟踪误差底线；另一方面持续迭代科创板量化因子，动态平衡各类因子暴露，力图在科创价格指数基准的基础上，获取相对稳健的超额收益。

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本基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重

大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，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，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、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复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.6.1	2,413,616.02	2,181,965.37
结算备付金		1,145,789.56	1,172,451.74
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.6.2	46,289,824.15	48,087,348.68
其中：股票投资		46,189,175.96	48,087,348.68
基金投资		-	-
债券投资		100,648.19	-
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		283,298.41	38,201.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	-	-
资产总计		50,132,528.14	51,479,967.17
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		489,181.67	705,731.74
应付管理人报酬		28,829.87	37,294.97
应付托管费		3,603.76	4,661.90
应付销售服务费		5,187.32	6,885.07
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.35	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	38,361.16	15,000.00
负债合计		565,166.13	769,573.68
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	24,723,405.86	37,677,234.28
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	24,843,956.15	13,033,159.21
净资产合计		49,567,362.01	50,710,393.49
负债和净资产总计		50,132,528.14	51,479,967.17

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 24,723,405.86 份。其中 A 类基金份额净值 2.0084 元，基金份额总额 15,548,187.46 份；C 类基金份额净值 1.9990 元，基金份额总额 9,175,218.40 份。

6.2 利润表

会计主体：博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026年1月1日至2026 年6月30日	上年度可比期间 2025年4月29日(基金 合同生效日)至2025年 6月30日
一、营业总收入		18,750,108.83	3,496,767.07
1.利息收入		3,598.33	42,659.86
其中：存款利息收入	6.4.6.9	3,598.33	42,659.86
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,229,979.75	2,452,375.85
其中：股票投资收益	6.4.6.10	6,142,076.24	1,792,418.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.11	15,964.26	468.86
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	-	49,379.54
股利收益	6.4.6.14	71,939.25	610,108.61
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	12,494,879.50	1,000,730.10
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	21,651.25	1,001.26
减：二、营业总支出		281,448.28	387,996.75
1. 管理人报酬		185,082.17	301,219.67
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-

2. 托管费		23,135.34	37,652.44
3. 销售服务费		34,600.58	38,027.01
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		0.25	177.97
8. 其他费用	6.4.6.18	38,629.94	10,919.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,468,660.55	3,108,770.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,468,660.55	3,108,770.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		18,468,660.55	3,108,770.32

6.3 净资产变动表

会计主体：博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	37,677,234.28	-	13,033,159.21	50,710,393.49
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	37,677,234.28	-	13,033,159.21	50,710,393.49
三、本期增减变动额	-12,953,828.42	-	11,810,796.94	-1,143,031.48

（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	18,468,660.55	18,468,660.55
（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）	-12,953,828.42	-	-6,657,863.61	-19,611,692.03
其中：1.基金申购款	21,193,792.96	-	11,836,740.74	33,030,533.70
2.基金赎回款	-34,147,621.38	-	-18,494,604.35	-52,642,225.73
（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	24,723,405.86	-	24,843,956.15	49,567,362.01

项目	上年度可比期间			
	2025年4月29日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	342,875,036.25	-	-	342,875,036.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-219,924,139.81	-	2,845,589.06	-217,078,550.75
（一）、综合收益总额	-	-	3,108,770.32	3,108,770.32
（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）	-219,924,139.81	-	-263,181.26	-220,187,321.07
其中：1.基金申购款	9,875,550.04	-	-111,298.58	9,764,251.46
2.基金赎回款	-229,799,689.85	-	-151,882.68	-229,951,572.53
（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	122,950,896.44	-	2,845,589.06	125,796,485.50

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

博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]585 号《关于准予博时上证科创板综合价格指数增强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《博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，本基金于 2025 年 4 月 7 日至 2025 年 4 月 25 日止期间募集不包括认购资金利息共募集人民币 342,804,369.43 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2025）验字第 70019484_A08 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 4 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 342,875,036.25 份基金份额，其中认购资金利息折合 70,666.82 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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《博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货、股票期权、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：上证科创板综合价格指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本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》、《博时上证科创板综合价格指数增强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	2,413,616.02
等于：本金	2,413,421.32
加：应计利息	194.70
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	2,413,616.02

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		32,441,577.35	-	46,189,175.96	13,747,598.61
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	100,085.00	558.19	100,648.19	5.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	100,085.00	558.19	100,648.19	5.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		32,541,662.35	558.19	46,289,824.15	13,747,603.61

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

6.4.6.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.6.5 其他资产

无余额。

6.4.6.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款	100.00
预提费用	38,261.16
合计	38,361.16

6.4.6.7 实收基金

博时上证科创板综合价格指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	23,581,671.32	23,581,671.32
本期申购	10,357,492.22	10,357,492.22
本期赎回（以“-”号填列）	-18,390,976.08	-18,390,976.08
本期末	15,548,187.46	15,548,187.46

博时上证科创板综合价格指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	14,095,562.96	14,095,562.96
本期申购	10,836,300.74	10,836,300.74
本期赎回（以“-”号填列）	-15,756,645.30	-15,756,645.30
本期末	9,175,218.40	9,175,218.40

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
博时上证科创板综合价格指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,071,423.38	117,868.61	8,189,291.99
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	8,071,423.38	117,868.61	8,189,291.99
本期利润	3,768,176.98	7,995,511.27	11,763,688.25
本期基金份额交易产生的变	-3,514,641.89	-760,298.21	-4,274,940.10

动数			
其中：基金申购款	4,626,739.89	944,972.73	5,571,712.62
基金赎回款	-8,141,381.78	-1,705,270.94	-9,846,652.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,324,958.47	7,353,081.67	15,678,040.14

博时上证科创板综合价格指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,772,411.10	71,456.12	4,843,867.22
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	4,772,411.10	71,456.12	4,843,867.22
本期利润	2,205,604.07	4,499,368.23	6,704,972.30
本期基金份额交易产生的变动数	-2,133,302.76	-249,620.75	-2,382,923.51
其中：基金申购款	4,867,444.54	1,397,583.58	6,265,028.12
基金赎回款	-7,000,747.30	-1,647,204.33	-8,647,951.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,844,712.41	4,321,203.60	9,165,916.01

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	2,733.37
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	860.72

其他	4.24
合计	3,598.33

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	102,956,427.91
减：卖出股票成本总额	96,714,701.97
减：交易费用	99,649.70
买卖股票差价收入	6,142,076.24

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	71.70
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	15,892.56
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	15,964.26

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	38,910.11

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付） 成本总额	23,000.00
减：应计利息总额	3.61
减：交易费用	13.94
买卖债券差价收入	15,892.56

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	71,939.25
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	71,939.25

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	12,494,879.50

——股票投资	12,494,874.50
——债券投资	5.00
——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	12,494,879.50

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	21,501.89
基金转换费收入	149.36
合计	21,651.25

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	6,041.70
信息披露费	32,219.46
证券出借违约金	-
其他	8.78

银行汇划费	360.00
合计	38,629.94

注：自 2026 年 5 月 28 日至 2026 年 6 月 30 日，基金管理人自主承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用。

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 4 月 29 日（基金合同 生效日）至 2025 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的管理费	185,082.17	301,219.67
其中：应支付销售机构的客户维护费	91,278.52	148,567.65
应支付基金管理人的净管理费	93,803.65	152,652.02

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 4 月 29 日（基金合同 生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	23,135.34	37,652.44

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时上证科创板综 合价格指数增强 A	博时上证科创板综合价 格指数增强 C	合计
中国农业银行	-	8,022.14	8,022.14
博时基金	-	206.65	206.65
合计	-	8,228.79	8,228.79
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时上证科创板综合价格指数增强 A	博时上证科创板综合价格指数增强 C	合计
中国农业银行	-	25,312.59	25,312.59
博时基金	-	4.32	4.32
合计	-	25,316.91	25,316.91

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 0.40% 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 × 0.40% / 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 4 月 29 日（基金合同生效日）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
中国农业银行-活期存款	2,413,616.02	2,733.37	14,664,106.56	37,712.09

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

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10 利润分配情况

无。

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

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	1,490.00	500,824.70	1,239,680.00	-

注：本基金截至 2026 年 6 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的证券，该类证券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为股票型指数增强基金，跟踪上证综合指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过数量化方法进行组合管理和风险控制，在力求对标的指数上证综合指数有效跟踪的基础上，力争实现超越基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

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	100,648.19	-
合计	100,648.19	-

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	2,413,616.02	-	-	-	2,413,616.02
结算备付金	1,145,789.56	-	-	-	1,145,789.56
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	100,648.19	-	-	46,189,175.96	46,289,824.15
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	283,298.41	283,298.41
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,660,053.77	-	-	46,472,474.37	50,132,528.14
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	489,181.67	489,181.67
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	28,829.87	28,829.87
应付托管费	-	-	-	3,603.76	3,603.76
应付销售服务费	-	-	-	5,187.32	5,187.32
应交税费	-	-	-	2.35	2.35
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	38,361.16	38,361.16
负债总计	-	-	-	565,166.13	565,166.13
利率敏感度缺口	3,660,053.77	-	-	45,907,308.24	49,567,362.01
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	2,181,965.37	-	-	-	2,181,965.37
结算备付金	1,172,451.74	-	-	-	1,172,451.74
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	48,087,348.68	48,087,348.68
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	38,201.38	38,201.38
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,354,417.11	-	-	48,125,550.06	51,479,967.17
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	705,731.74	705,731.74
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	37,294.97	37,294.97
应付托管费	-	-	-	4,661.90	4,661.90
应付销售服务费	-	-	-	6,885.07	6,885.07
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	15,000.00	15,000.00
负债总计	-	-	-	769,573.68	769,573.68

利率敏感度缺口	3,354,417.11	-	-47,355,976.38	50,710,393.49
---------	--------------	---	----------------	---------------

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

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 0	-
	市场利率下降 25 个基点	增加约 0	-

注：1.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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
----	------------------------	--------------------------

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	46,189,175.96	93.18	48,087,348.68	94.83
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	46,189,175.96	93.18	48,087,348.68	94.83

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 246	增加约 249
	业绩比较基准下降 5%	减少约 246	减少约 249

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	44,949,495.96
第二层次	1,340,328.19
第三层次	-
合计	46,289,824.15

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	46,189,175.96	92.13
	其中：股票	46,189,175.96	92.13
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	100,648.19	0.20
	其中：债券	100,648.19	0.20
	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	3,559,405.58	7.10
8	其他各项资产	283,298.41	0.57
9	合计	50,132,528.14	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	36,216,659.98	73.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,609,226.14	15.35
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,740,670.34	3.51
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	45,566,556.46	91.93

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	622,619.50	1.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	622,619.50	1.26

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	688256	寒武纪	2,204	3,516,592.20	7.09
2	688041	海光信息	6,649	2,462,124.70	4.97
3	688012	中微公司	3,307	1,549,329.50	3.13
4	688072	拓荆科技	1,490	1,239,680.00	2.50
5	688008	澜起科技	3,630	1,124,937.00	2.27
6	688795	摩尔线程	1,553	1,112,708.97	2.24
7	688498	源杰科技	580	1,093,880.00	2.21
8	688802	沐曦股份	1,200	993,960.00	2.01
9	688981	中芯国际	6,247	992,148.54	2.00
10	688525	佰维存储	2,000	989,460.00	2.00
11	688396	华润微	9,250	902,337.50	1.82
12	688521	芯原股份	2,200	816,508.00	1.65
13	688002	睿创微纳	4,182	646,913.58	1.31
14	688146	中船特气	1,700	594,983.00	1.20
15	688266	泽璟制药	5,050	589,133.00	1.19
16	688630	芯碁微装	1,000	549,390.00	1.11
17	688766	普冉股份	700	536,620.00	1.08
18	688409	富创精密	1,700	520,625.00	1.05
19	688578	艾力斯	4,600	502,320.00	1.01
20	688347	华虹宏力	1,400	470,820.00	0.95
21	688110	东芯股份	2,300	468,510.00	0.95
22	688183	生益电子	3,092	409,380.80	0.83
23	688629	华丰科技	2,100	393,771.00	0.79
24	688519	南亚新材	1,000	380,040.00	0.77

25	688059	华锐精密	1,900	379,449.00	0.77
26	688036	传音控股	6,400	377,280.00	0.76
27	688045	必易微	4,600	371,588.00	0.75
28	688220	翱捷科技	2,900	360,528.00	0.73
29	688503	聚和材料	2,700	358,290.00	0.72
30	688269	凯立新材	11,200	355,152.00	0.72
31	688599	天合光能	24,876	351,249.12	0.71
32	688361	中科飞测	800	344,000.00	0.69
33	688202	美迪西	4,254	343,340.34	0.69
34	688221	前沿生物	14,900	333,760.00	0.67
35	688025	杰普特	700	329,000.00	0.66
36	688609	九联科技	29,714	327,151.14	0.66
37	688522	纳睿雷达	16,200	324,324.00	0.65
38	688046	药康生物	13,300	321,860.00	0.65
39	688692	达梦数据	1,300	317,577.00	0.64
40	688702	盛科通信	800	311,992.00	0.63
41	688120	华海清科	927	298,660.86	0.60
42	688111	金山办公	1,400	298,270.00	0.60
43	688331	荣昌生物	2,263	294,778.38	0.59
44	688536	思瑞浦	800	291,272.00	0.59
45	688728	格科微	13,800	290,352.00	0.59
46	688297	中无人机	6,900	286,695.00	0.58
47	688179	阿拉丁	10,100	279,871.00	0.56
48	688410	山外山	19,295	277,076.20	0.56
49	688090	瑞松科技	2,600	276,770.00	0.56
50	688172	燕东微	3,200	267,712.00	0.54
51	688155	先惠技术	3,300	266,937.00	0.54
52	688200	华峰测控	496	260,449.60	0.53
53	688469	芯联集成	24,100	255,701.00	0.52
54	688620	安凯微	15,700	254,340.00	0.51
55	688037	芯源微	550	241,477.50	0.49
56	688222	成都先导	7,500	240,825.00	0.49
57	688652	京仪装备	1,200	240,204.00	0.48
58	688127	蓝特光学	2,400	234,240.00	0.47
59	688257	新锐股份	2,240	228,256.00	0.46
60	688392	骄成超声	1,000	227,180.00	0.46
61	688475	萤石网络	8,230	225,090.50	0.45
62	688400	凌云光	3,400	225,080.00	0.45
63	688548	广钢气体	4,300	224,030.00	0.45
64	688668	鼎通科技	600	223,980.00	0.45
65	688615	合合信息	1,940	219,414.00	0.44
66	688308	欧科亿	1,200	218,172.00	0.44
67	688627	精智达	300	214,500.00	0.43

68	688531	日联科技	1,200	213,408.00	0.43
69	688755	汉邦科技	7,420	204,495.20	0.41
70	688530	欧莱新材	1,900	184,110.00	0.37
71	688368	晶丰明源	840	181,876.80	0.37
72	688275	万润新能	1,400	178,570.00	0.36
73	688223	晶科能源	37,452	177,897.00	0.36
74	688113	联测科技	5,000	175,500.00	0.35
75	688388	嘉元科技	3,875	170,500.00	0.34
76	688700	东威科技	1,900	169,860.00	0.34
77	688049	炬芯科技	3,600	168,876.00	0.34
78	688378	奥来德	2,703	167,586.00	0.34
79	688372	伟测科技	900	167,400.00	0.34
80	688017	绿的谐波	400	167,144.00	0.34
81	688313	仕佳光子	900	166,185.00	0.34
82	688717	艾罗能源	2,000	165,140.00	0.33
83	688777	中控技术	1,400	164,500.00	0.33
84	688559	海目星	1,936	162,469.12	0.33
85	688336	三生国健	2,990	158,769.00	0.32
86	688148	芳源股份	18,500	158,730.00	0.32
87	688699	明微电子	1,900	155,705.00	0.31
88	688549	中巨芯	4,200	154,602.00	0.31
89	688102	斯瑞新材	3,260	153,806.80	0.31
90	688383	新益昌	800	150,432.00	0.30
91	688205	德科立	700	145,733.00	0.29
92	688553	汇宇制药	13,260	140,953.80	0.28
93	688009	中国通号	28,900	137,564.00	0.28
94	688626	翔宇医疗	3,100	137,206.00	0.28
95	688309	恒誉环保	2,200	133,936.00	0.27
96	688248	南网科技	1,900	131,442.00	0.27
97	688600	皖仪科技	3,900	129,792.00	0.26
98	688082	盛美上海	300	129,600.00	0.26
99	688580	伟思医疗	2,400	127,848.00	0.26
100	688128	中国电研	5,300	125,822.00	0.25
101	688262	国芯科技	2,900	125,367.00	0.25
102	688030	山石网科	7,700	121,583.00	0.25
103	688295	中复神鹰	2,000	121,080.00	0.24
104	688411	海博思创	400	116,480.00	0.23
105	688585	上纬新材	700	116,060.00	0.23
106	688126	沪硅产业	2,900	115,681.00	0.23
107	688328	深科达	1,200	114,840.00	0.23
108	688660	电气风电	13,100	112,922.00	0.23
109	688472	阿特斯	10,400	112,528.00	0.23
110	688279	峰昭科技	500	112,220.00	0.23

111	688456	有研粉材	800	111,680.00	0.23
112	688345	博力威	1,900	110,352.00	0.22
113	688087	英科再生	3,300	110,286.00	0.22
114	688710	益诺思	1,600	107,520.00	0.22
115	688333	铂力特	1,000	102,400.00	0.21
116	688003	天准科技	800	101,840.00	0.21
117	688027	国盾量子	200	100,802.00	0.20
118	688359	三孚新科	500	99,220.00	0.20
119	688778	厦钨新能	1,800	97,920.00	0.20
120	688239	航宇科技	1,600	95,728.00	0.19
121	688211	中科微至	2,500	86,050.00	0.17
122	688690	纳微科技	1,900	83,790.00	0.17
123	688167	炬光科技	235	83,239.35	0.17
124	688219	会通股份	6,400	82,816.00	0.17
125	688708	佳驰科技	1,626	82,600.80	0.17
126	688107	安路科技	1,800	82,080.00	0.17
127	688175	高凌信息	3,210	80,731.50	0.16
128	688787	海天瑞声	600	80,670.00	0.16
129	688006	杭可科技	2,125	77,668.75	0.16
130	688293	奥浦迈	1,800	75,042.00	0.15
131	688188	柏楚电子	700	74,690.00	0.15
132	688449	联芸科技	853	73,622.43	0.15
133	688757	胜科纳米	1,100	73,370.00	0.15
134	688095	福昕软件	1,225	72,801.75	0.15
135	688605	先锋精科	689	71,669.78	0.14
136	688165	埃夫特	3,500	71,400.00	0.14
137	688206	概伦电子	1,600	70,992.00	0.14
138	688097	博众精工	1,100	69,355.00	0.14
139	688019	安集科技	200	67,892.00	0.14
140	688545	兴福电子	500	66,530.00	0.13
141	688612	威迈斯	2,200	65,098.00	0.13
142	688230	芯导科技	800	63,048.00	0.13
143	688195	腾景科技	280	53,922.40	0.11
144	688610	埃科光电	200	52,680.00	0.11
145	688048	长光华芯	100	50,200.00	0.10
146	688300	联瑞新材	200	48,880.00	0.10
147	688258	卓易信息	400	47,416.00	0.10
148	688365	光云科技	3,000	47,310.00	0.10
149	688518	联赢激光	1,500	46,350.00	0.09
150	688390	固德威	400	43,404.00	0.09
151	688065	凯赛生物	900	43,065.00	0.09
152	688625	呈和科技	500	42,205.00	0.09
153	688379	华光新材	500	42,015.00	0.08

154	688323	瑞华泰	700	39,550.00	0.08
155	688560	明冠新材	3,300	39,105.00	0.08
156	688557	兰剑智能	1,200	37,236.00	0.08
157	688733	壹石通	900	37,215.00	0.08
158	688158	优刻得	1,000	36,760.00	0.07
159	688416	恒烁股份	260	36,400.00	0.07
160	688639	华恒生物	2,100	33,894.00	0.07
161	688661	和林微纳	200	31,796.00	0.06
162	688227	品高股份	300	30,807.00	0.06
163	688337	普源精电	400	29,972.00	0.06
164	688499	利元亨	528	27,746.40	0.06
165	688552	航天南湖	900	25,317.00	0.05
166	688369	致远互联	1,196	25,127.96	0.05
167	688321	微芯生物	943	24,829.19	0.05
168	688301	奕瑞科技	200	24,800.00	0.05
169	688516	奥特维	400	22,956.00	0.05
170	688218	江苏北人	400	21,984.00	0.04
171	688603	天承科技	100	20,795.00	0.04
172	688099	晶晨股份	200	20,580.00	0.04
173	688035	德邦科技	200	18,360.00	0.04
174	688382	益方生物	1,000	18,000.00	0.04
175	688316	青云科技	300	16,200.00	0.03
176	688360	德马科技	900	16,110.00	0.03
177	688335	复洁科技	600	14,424.00	0.03
178	688611	杭州柯林	200	14,290.00	0.03
179	688648	中邮科技	300	10,965.00	0.02
180	688114	华大智造	200	10,216.00	0.02
181	688750	金天钛业	500	8,315.00	0.02
182	688593	新相微	200	7,784.00	0.02
183	688758	赛分科技	200	4,402.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	603061	金海通	200.00	100,444.00	0.20
2	002008	大族激光	600.00	90,066.00	0.18
3	002371	北方华创	100.00	88,456.00	0.18
4	300316	晶盛机电	1,000.00	60,400.00	0.12
5	003043	华亚智能	600.00	59,634.00	0.12
6	688729	屹唐股份	1,150.00	49,450.00	0.10
7	301369	联动科技	200.00	49,000.00	0.10

8	603203	快克智能	500.00	38,390.00	0.08
9	603690	至纯科技	1,000.00	35,400.00	0.07
10	300604	长川科技	100.00	34,142.00	0.07
11	920394	民士达	250.00	17,237.50	0.03

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	688795	摩尔线程	1,306,956.88	2.58
2	688256	寒武纪	873,309.84	1.72
3	688120	华海清科	803,064.00	1.58
4	688522	纳睿雷达	801,812.88	1.58
5	688802	沐曦股份	783,869.70	1.55
6	688373	盟科药业	761,037.24	1.50
7	688439	振华风光	758,753.38	1.50
8	688002	睿创微纳	734,980.41	1.45
9	688238	和元生物	720,603.57	1.42
10	688110	东芯股份	717,111.04	1.41
11	688396	华润微	716,805.07	1.41
12	688219	会通股份	702,520.15	1.39
13	688538	和辉光电	696,473.06	1.37
14	688047	龙芯中科	689,559.23	1.36
15	688036	传音控股	681,458.48	1.34
16	688531	日联科技	680,420.35	1.34
17	688400	凌云光	603,302.38	1.19
18	688059	华锐精密	600,240.88	1.18
19	688553	汇宇制药	595,499.12	1.17
20	688223	晶科能源	591,026.81	1.17

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	688256	寒武纪	2,347,299.02	4.63
2	688041	海光信息	2,073,294.51	4.09
3	688012	中微公司	1,471,631.59	2.90

4	688002	睿创微纳	1,124,221.44	2.22
5	688200	华峰测控	1,047,538.00	2.07
6	688449	联芸科技	1,013,646.16	2.00
7	688522	纳睿雷达	988,518.84	1.95
8	688271	联影医疗	981,290.86	1.94
9	688008	澜起科技	953,975.00	1.88
10	688120	华海清科	941,088.44	1.86
11	688188	柏楚电子	931,168.25	1.84
12	688072	拓荆科技	892,594.00	1.76
13	688182	灿勤科技	884,589.34	1.74
14	688047	龙芯中科	877,885.95	1.73
15	688531	日联科技	872,926.07	1.72
16	688981	中芯国际	846,843.04	1.67
17	688553	汇宇制药	804,031.90	1.59
18	688538	和辉光电	782,983.61	1.54
19	688690	纳微科技	781,944.89	1.54
20	688428	诺诚健华	763,553.70	1.51

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	82,321,654.75
卖出股票的收入（成交）总额	102,956,427.91

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	100,648.19	0.20
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	100,648.19	0.20

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	1,000	100,648.19	0.20

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	283,298.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	283,298.41

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

7.12.5.1 期末指数投资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	688072	拓荆科技	1,239,680.00	2.50	重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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
博时上证科创板综合价格指数增强 A	3,103	5,010.70	-	-	15,548,187.46	100.00%
博时上证科创板综合价格指数增强 C	2,256	4,067.03	-	-	9,175,218.40	100.00%
合计	5,281	4,681.58	-	-	24,723,405.86	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

- 1、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。
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时上证科创板综合价格指数增强 A	博时上证科创板综合价格指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 4 月 29 日）基金份额总额	261,875,638.62	80,999,397.63
本报告期期初基金份额总额	23,581,671.32	14,095,562.96
本报告期基金总申购份额	10,357,492.22	10,836,300.74

减：本报告期基金总赎回份额	18,390,976.08	15,756,645.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	15,548,187.46	9,175,218.40

§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

本基金自基金合同生效日起，聘请容诚会计师事务所(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，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	
方正证券	3	97,577,637.38	52.67%	19,132.39	52.69%	增加 1 个
国新证券	3	87,700,445.28	47.33%	17,181.72	47.31%	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
方正证券	120,558.97	86.74%	-	-	-	-
国新证券	18,436.14	13.26%	-	-	-	-

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	博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金（博时上证科创板综合价格指数增强 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	博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金（博时上证科创板综合价格指数增强 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	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
5	博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金 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
6	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
7	博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金 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
8	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
9	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
10	博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金（博时上证科创板综合价格指数增强 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	2026-02-11
11	博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金（博时上证科创板综合价格指数增强 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	2026-02-11
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	博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金 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上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日