博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时沪港深优质企业
基金主代码	001215
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 14 日
报告期末基金份额总额	96,110,780.22 份
投资目标	本基金通过对符合或引领中国经济转型优质企业的深入研究，把握沪港通及后续资本市场开放政策带来的投资机会，在严格控制估值风险及流动性风险的前提下，获取基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略分三个层次：首先是大类资产配置，即根据经济周期决定权益类证券和固定收益类证券的投资比例；其次是行业配置，即根据行业发展规律和内在逻辑，在不同行业之间进行动态配置；最后是个股选择策略、存托凭证投资策略和债券投资策略。投资策略主要包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、金融衍生品投资策略、套利策略、资产支持证券的投资策略。

业绩比较基准	中证 A500 指数收益率*45%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*40%+中债-国债总财富（1-3 年）指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险/收益品种。本基金除了投资于 A 股市场优质企业外，还可在法律法规规定的范围内投资香港联合交易所上市的股票。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。	
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	
下属分级基金的基金简称	博时沪港深优质企业 A	博时沪港深优质企业 C
下属分级基金的交易代码	001215	002555
报告期末下属分级基金的份额总额	84,938,136.12 份	11,172,644.10 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)	
	博时沪港深优质企业 A	博时沪港深优质企业 C
1.本期已实现收益	10,138,701.82	1,076,066.41
2.本期利润	-58,711,500.28	-5,347,520.10
3.加权平均基金份额本期利润	-0.6857	-0.5516
4.期末基金资产净值	145,619,822.41	18,917,467.02
5.期末基金份额净值	1.714	1.693

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不包含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1．博时沪港深优质企业A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-28.40%	3.67%	-5.87%	0.87%	-22.53%	2.80%
过去六个月	23.58%	3.29%	-0.53%	0.85%	24.11%	2.44%
过去一年	0.94%	2.70%	-1.53%	0.81%	2.47%	1.89%
过去三年	55.96%	2.19%	26.06%	0.81%	29.90%	1.38%
过去五年	0.76%	2.00%	14.75%	0.76%	-13.99%	1.24%
过去七年	70.55%	1.86%	39.49%	0.76%	31.06%	1.10%
过去十年	139.72%	1.66%	37.53%	0.73%	102.19%	0.93%
自基金合同生效起至今	71.40%	1.78%	25.42%	0.81%	45.98%	0.97%

2．博时沪港深优质企业C：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-28.51%	3.66%	-5.87%	0.87%	-22.64%	2.79%
过去六个月	23.31%	3.29%	-0.53%	0.85%	23.84%	2.44%
过去一年	0.42%	2.70%	-1.53%	0.81%	1.95%	1.89%
过去三年	53.49%	2.20%	26.06%	0.81%	27.43%	1.39%
过去五年	-1.74%	2.01%	14.75%	0.76%	-16.49%	1.25%
过去七年	64.53%	1.86%	39.49%	0.76%	25.04%	1.10%
过去十年	127.86%	1.66%	37.53%	0.73%	90.33%	0.93%
自基金合同生效起至今	147.51%	1.64%	45.37%	0.73%	102.14%	0.91%

注：自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中国债券总财富指数收益率*40%+中证 500 指数收益率*40%+恒生综合指数收益率*20%”调整为“中证 A500 指数收益率*45%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*40%+中债-国债总财富（1-3 年）指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

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

1．博时沪港深优质企业A：



2．博时沪港深优质企业C：



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾鹏	公司董事总经理/权益投研一体化总监/权益投资四部投资总监/境	2021-01-20	-	21.5	曾鹏先生，硕士。2005 年起先后在上投摩根基金、嘉实基金从事研究、投资工作。2012 年加入博时基金管理有限公司。历任投资经理、博时灵活配置混合型证券投资基金(2015 年 2 月 9 日-2016 年 4 月 25 日)基金经理、权益投资主题组负

	外投资部总经理/权益投资四部总经理/基金经理				责人、权益投资总部一体化投研总监、博时港股通领先趋势混合型证券投资基金(2021 年 2 月 9 日-2022 年 7 月 9 日)、博时科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）(2019 年 6 月 27 日-2024 年 7 月 3 日)、博时科技创新混合型证券投资基金(2020 年 4 月 15 日-2024 年 7 月 3 日)、博时新兴消费主题混合型证券投资基金(2021 年 1 月 20 日-2024 年 7 月 3 日)、博时半导体主题混合型证券投资基金(2021 年 7 月 20 日-2024 年 7 月 3 日)、博时消费创新混合型证券投资基金(2021 年 11 月 8 日-2024 年 7 月 3 日)、博时时代领航混合型证券投资基金(2022 年 1 月 25 日-2024 年 7 月 3 日)的基金经理。现任公司董事总经理兼权益投研一体化总监、权益投资四部总经理、权益投资四部投资总监、境外投资部总经理、博时新兴成长混合型证券投资基金(2013 年 1 月 18 日—至今)、博时特许价值混合型证券投资基金(2018 年 6 月 21 日—至今)、博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金(2021 年 1 月 20 日—至今)、博时军工主题股票型证券投资基金(2022 年 6 月 29 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遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 11 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年三季度是 AI 高景气赛道的震荡消化期，产业趋势没有证伪，但市场从“估值扩张”转向“估值消化”。报告期内基金维持了中高仓位运作。集中持仓在与 AI 产业链紧密相关的硬件领域，并围绕相关领域的上下游产业链进行投资布局。虽然在结构上进行了适当调整，但三季度在“双创”指数大幅回调情况下，基金净值也出现了一定回撤。

展望四季度，我们认为市场会震荡转暖，结构性机会优于三季度。A 股经历了三季度的估值消化，四季度进入估值切换阶段，盈利驱动将成为主导。“结构性慢牛”的本质，是盈利驱动而非流动性驱动，科技仍是主线但将进入业绩验证期。因此，对投资者而言，“摒弃普涨思维、以业绩为准绳筛选标的”是四季度的核心投资逻辑。A 股市场的“K 型分化”本质是 AI 技术革命带来的产业范式切换在资本市场的投射。“K 型分化”会收敛，但不会逆转。我们依然看好业绩兑现度最高的算力硬件及相关的产业链上下游。我们将努力把握好相关的投资机会，为持有人创造有价值的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 09 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.714 元，份额累计净值为 1.714 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.693 元，份额累计净值为 1.693 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-28.40%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-28.51%，同期业绩基准增长率为-5.87%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	145,393,517.16	88.14
	其中：股票	145,393,517.16	88.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,867,524.49	4.77
	其中：债券	7,867,524.49	4.77
	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	9,873,686.79	5.99
8	其他各项资产	1,815,405.11	1.10
9	合计	164,950,133.55	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 27,087,026.76 元，净值占比 16.46%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	15,761.90	0.01
C	制造业	93,042,536.71	56.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	64,520.72	0.04
E	建筑业	2,313,630.00	1.41
F	批发和零售业	10,956,660.00	6.66

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	11,913,381.07	7.24
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	118,306,490.40	71.90

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	17,055,165.81	10.37
医疗保健	10,031,860.95	6.10
合计	27,087,026.76	16.46

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	00981	中芯国际	248,000	12,911,666.90	7.85
2	002384	东山精密	75,200	12,588,480.00	7.65
3	688256	寒武纪	11,807	11,913,381.07	7.24
4	300394	天孚通信	44,800	11,682,496.00	7.10
5	300475	香农芯创	71,500	10,956,660.00	6.66
6	601208	东材科技	225,800	10,888,076.00	6.62
7	600183	生益科技	82,300	10,695,708.00	6.50
8	02269	药明生物	208,500	10,031,860.95	6.10
9	300308	中际旭创	8,600	6,952,584.00	4.23

10	002475	立讯精密	117,900	5,827,797.00	3.54

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	7,867,524.49	4.78
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	7,867,524.49	4.78

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019827	26 国债 01	78,000	7,867,524.49	4.78

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

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

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	18,014.50
2	应收证券清算款	1,685,871.35
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	111,519.26
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	1,815,405.11

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时沪港深优质企业A	博时沪港深优质企业C
本报告期期初基金份额总额	87,332,478.01	9,339,620.20
报告期期间基金总申购份额	4,986,565.93	4,411,534.22
减：报告期期间基金总赎回份额	7,380,907.82	2,578,510.32
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	84,938,136.12	11,172,644.10

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会批准博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

2、《博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3、《博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

5、博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金各年度审计报告正本

6、报告期内博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日