# 博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金
# 2025 年年度报告
# 2025 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：国泰海通证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年三月三十一日

# §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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 6 月 18 日起至 12 月 31 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 ..... 4
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、基金净值表现及利润分配情况 ..... 5**
3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 5
3.2 基金净值表现 ..... 6
3.3 过去三年基金的利润分配情况 ..... 7
**§4 管理人报告 ..... 7**
4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 8
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 ..... 9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 ..... 10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 11
4.9 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遵规守信情况声明 ..... 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... 12
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 ..... 12
**§6 审计报告 ..... 12**
6.1 审计意见 ..... 13
6.2 形成审计意见的基础 ..... 13
6.3 其他信息 ..... 13
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任 ..... 13
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任 ..... 14
**§7 年度财务报表 ..... 15**
7.1 资产负债表 ..... 15
7.2 利润表 ..... 16
7.3 净资产变动表 ..... 17
7.4 报表附注 ..... 18
**§8 投资组合报告 ..... 41**
8.1 期末基金资产组合情况 ..... 41
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 ..... 42
8.3 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 ..... 42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 44

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 47
8.6 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 ..... 47
8.7 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 ..... 47
8.8 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 ..... 47
8.9 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 ..... 47
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 ..... 47
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 48
8.12 投资组合报告附注 ..... 48
**§9 基金份额持有人信息 ..... 48**
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 49
9.2 期末上市基金前十名持有人 ..... 49
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 49
9.4 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 ..... 49
**§10 开放式基金份额变动 ..... 49**
**§11 重大事件揭示 ..... 50**
11.1 基金份额持有人大会决议 ..... 50
11.2 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 ..... 50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 50
11.4 基金投资策略的改变 ..... 50
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 50
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 ..... 50
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 ..... 51
11.8 其他重大事件 ..... 52
**§12 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 54**
12.1 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 ..... 54
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 55
**§13 备查文件目录 ..... 55**
13.1 备查文件目录 ..... 55
13.2 存放地点 ..... 55
13.3 查阅方式 ..... 56

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 博时国证大盘成长 ETF |
| 场内简称 | 大盘成长 ETF 博时 |
| 基金主代码 | 159203 |
| 交易代码 | 159203 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2025 年 6 月 18 日 |
| 基金管理人 | 博时基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 国泰海通证券股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 5,791,913.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2025 年 6 月 30 日 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。<br>本基金的投资策略还包括债券（除可转换债券、可交换债券）投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、金融衍生品投资策略、融资和转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略等。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即国证大盘成长指数收益率。 |
| 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。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪国证大盘成长指数，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。 |

## 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 | 国泰海通证券股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 吴曼 | 帅芳 |
| | 联系电话 | 0755-83169999 | 021-38677947 |
| | 电子邮箱 | service@bosera.com | tgrxp@tg.gtht.com |

| | | |
|---|---|---|
| 客户服务电话 | 95105568 | 021-38917599-5 |
| 传真 | 0755-83195140 | 021-50872603 |
| 注册地址 | 深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层 | 中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号 |
| 办公地址 | 广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层 | 上海市静安区新闸路 669 号博华广场 19 楼 |
| 邮政编码 | 518040 | 200041 |
| 法定代表人 | 张东 | 朱健 |

## 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 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | https://www.bosera.com |
| 基金年度报告备置地点 | 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 |
|---|---|---|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

# §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 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 | 2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 7,464,455.83 |
| 本期利润 | 8,095,138.99 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2227 |
| 本期加权平均净值利润率 | 20.94% |
| 本期基金份额净值增长率 | 33.23% |
| **3.1.2 期末数据和指标** | **2025 年末** |
| 期末可供分配利润 | 1,924,418.69 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3323 |
| 期末基金资产净值 | 7,716,331.69 |
| 期末基金份额净值 | 1.3323 |
| **3.1.3 累计期末指标** | **2025 年末** |
| 基金份额累计净值增长率 | 33.23% |

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。

本基金合同于 2025 年 06 月 18 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

## 3.2 基金净值表现

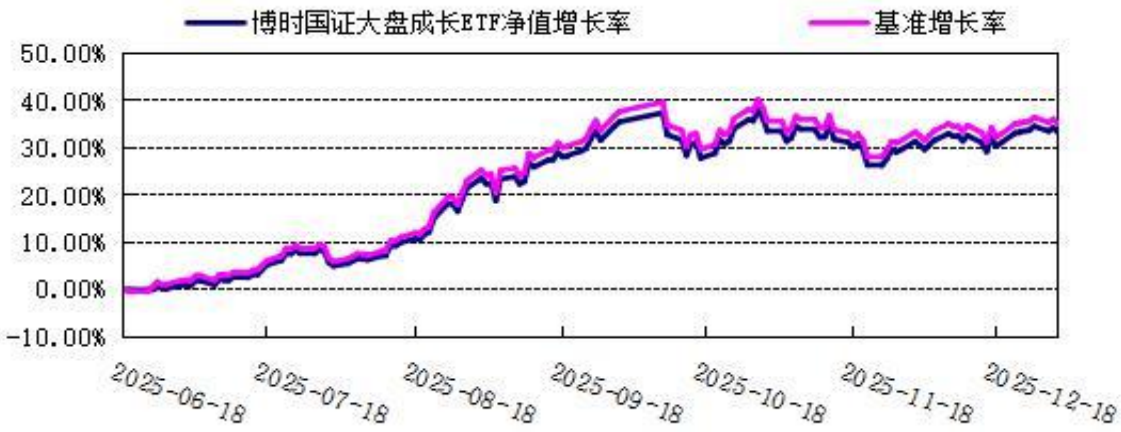
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | -1.69% | 1.31% | -1.96% | 1.35% | 0.27% | -0.04% |
| 过去六个月 | 31.92% | 1.27% | 32.37% | 1.30% | -0.45% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 33.23% | 1.23% | 35.01% | 1.26% | -1.78% | -0.03% |

### 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

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

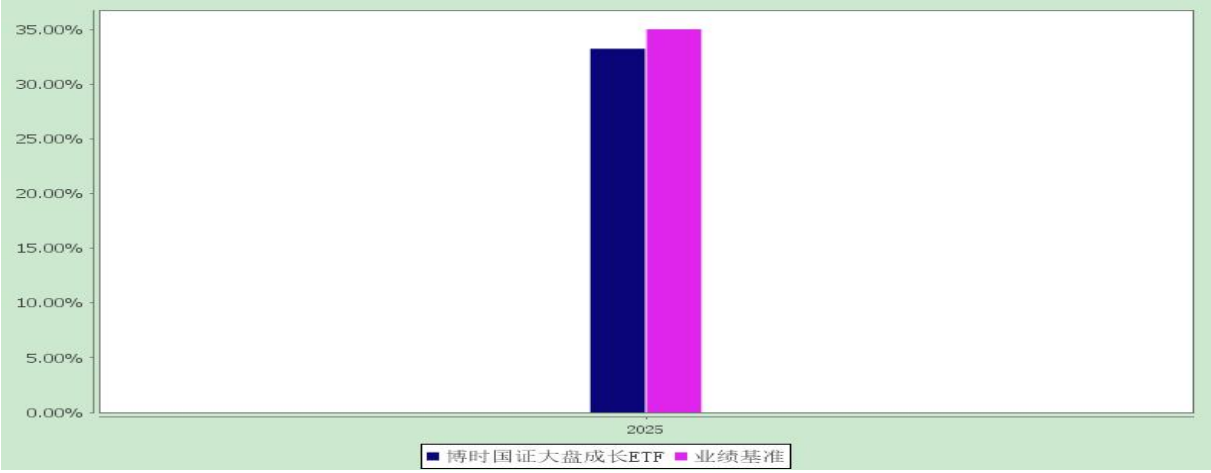
(2025 年 6 月 18 日至 2025 年 12 月 31 日)




注：本基金的基金合同于 2025 年 6 月 18 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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图




注：本基金的基金合同于 2025 年 6 月 18 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## §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 2025 年 12 月 31 日，博时基金管理有限公司共管理 403 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 16746 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 6938 亿元人民币，累计分红逾 2258 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。

其他大事件

9 月，深圳市证券业协会召开深圳资本市场投教讲师工作交流会，举行投教讲师聘任仪式，博时基金 16 位员工获颁“深圳资本市场投资者教育讲师”聘书。

12 月，深圳市证券业协会授予博时基金“突出贡献单位”荣誉证书，授予博时基金投教基地“优秀投资者教育基地”荣誉证书，表彰公司在 2025 年度投资者教育工作中积极有为，表现优异。2025 年度，博时基金共四位员工获得“优秀投教讲师”荣誉证书。

### 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 | 2025-06-18 | - | 10.4 | 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，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 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了公平交易管理机制，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固

定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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 37 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

2025 年 A 股市场整体呈现震荡上行的结构性行情，核心指数表现分化。分季度来看，市场呈现明显的阶段性特征：一季度市场在延续去年底的调整后企稳回升，春节后受技术突破与产业催化驱动，风险偏好回升；二季度在内外因素博弈中高位震荡，整体维持强势；三季度科技主线进一步深化，“双创”板块成为核心驱动力；四季度整体震荡加剧，投资者获利了结情绪显现，临近年末逐步企稳，风格呈现再平衡特征。风格上呈现“成长主导、大小盘交替”的特征，全年成长风格显著优于价值风格，小盘与大盘风格随季度变化呈现阶段性切换：一季度，科技主线主导市场，小盘成长风格明确占优；二季度，小盘成长风格虽有波动，但整体仍保持相对优势，风格分化略有收敛；三季度，风格出现边际变化，大盘略优于小盘，成长风格进一步强化，大盘成长指数大幅上涨，而大盘价值指数下跌；四季度，风格经历多轮切换，季度伊始小盘与价值相对占优，中期震荡过程中价值股跌幅更小，临近年末成长、小盘风格再度回归优势，整体风格回归成长主线。全年来看，成长风格的持续性与确定性最强，核心得益于新兴产业的快速发展与流动性宽松环境的支撑。行业上分化显著，新兴产业相关板块与资源类板块领涨，顺周期、消费及部分稳定类行业表现低迷。

大盘成长指数囊括众多行业龙头企业，在经济复苏阶段大盘成长股往往可能率先受益。本基金作为跟踪大盘成长指数的指数基金，主要利用数量化手段对组合进行管理，严格控制与指数的跟踪偏离。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 1.3323 元，份额累计净值为 1.3323 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 33.23%，同期业绩基准增长率 35.01%。

## 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，宏观经济与市场环境整体延续 2025 年的核心特征，同时产业趋势进一步深化，结构性机会或仍将是市场主线：宏观环境方面，海外美联储仍处于宽松周期，但通胀压力仍将压制降息幅度，从而影响全球景气和国内的出口预期；国内经济仍将处于低利率和稳增长的环境中，出口需求有望持续回暖，PPI 低位运行态势可能逐步改善，经济基本面有望稳步复苏，但仍面临一定挑战。整体来看，流动性宽松环境仍将持续，权益资产配置价值凸显。产业趋势方面，AI、机器人、创新药、商业航天等新兴产业的发展进程将持续加快，相关领域的技术突破与产业落地将带来更多结构性机会。但整体市场经历了过去一年多的估值修复，业绩能否兑现需要持续跟踪，同时国际环境也可能带来风险偏好的扰动。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，持续健全内控体系，完善内控制度、机制和流程，夯实内控管理基础；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、预警提示、定期检查、专项审计等方式，及时发现问题，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司风险管理部牵头开展内控管理工作，推动内控机制完善与执行；公司法律合规部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时提示有关业务人员并向管理层报告；公司审计部针对基金投研交、市场销售、后台运营、信息技术等开展内部审计项目，作出独立客观的监督、评价和建议。

报告期内，内控制度方面，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步健全内控管理机制，新建或修订了《博时基金风险管理与内部控制管理制度》《博时基金合规管理制度》《博时基金问责管理制度》《博时基金关联交易管理制度》《博时基金洗钱风险管理制度》《博时基金销售管理制度》《博时基金私募资产管理业务基本制度》《博时基金信息技术管理制度》《博时基金管理有限公司交易管理制度》等制度文件。系统建设方面，持续对“新一代决策支持系统”、“指标中心”、“博时产品管理系统”、“统一风险管理平台”等管理平台系统功能进行迭代更新，探索完善“合规管理平台”中应用模块的数智化功能，进一步提升公司市场体系、投研体系、后台运作、风险合规管理的系统支持能力。基金销售方面，在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，

按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及内部制度的规定，审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并积极做好投资者教育工作。

## 4.7 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。

## 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金份额的收益分配方式采用现金分红；当收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 0.01%以上时，可进行收益分配；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关、证券交易所、登记机构另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致后可对基金收益分配原则进行调整，并及时公

告。

本报告期内本基金未进行收益分配。

### 4.9 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了 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，国泰海通证券股份有限公司（以下称"本托管人"）在博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

## §6 审计报告

安永华明（2026）审字第 70019484_A196 号

博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

## 6.1 审计意见

我们审计了博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 其他信息

博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金的持续

经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）　　中国注册会计师

楼坚　王海彦

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2026 年 3 月 27 日

# §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| **资 产：** | | |
| 货币资金 | 7.4.7.1 | 126,651.61 |
| 结算备付金 | | 23,061.11 |
| 存出保证金 | | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 7,542,558.57 |
| 其中：股票投资 | | 7,542,558.57 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | - |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 其他投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - |
| 债权投资 | | - |
| 其中：债券投资 | | - |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 其他投资 | | - |
| 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 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 7.4.7.5 | 41,751.52 |
| 资产总计 | | 7,734,022.81 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>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 | 7.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - |
| 应付清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 4,708.69 |
| 应付托管费 | | 941.75 |
| 应付销售服务费 | | - |
| 应付投资顾问费 | | - |
| 应交税费 | | - |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 7.4.7.6 | 12,040.68 |
| 负债合计 | | 17,691.12 |
| **净资产：** | | |
| 实收基金 | 7.4.7.7 | 5,791,913.00 |
| 其他综合收益 | | - |
| 未分配利润 | 7.4.7.8 | 1,924,418.69 |
| 净资产合计 | | 7,716,331.69 |
| 负债和净资产总计 | | 7,734,022.81 |

注：1.报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3323 元，基金份额总额 5,791,913.00 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2025 年 6 月 18 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期<br>2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | **8,269,852.92** |
| 1.利息收入 | | 24,750.14 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.9 | 24,750.14 |
| 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） | | 6,991,190.59 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.10 | 6,276,798.50 |
| 基金投资收益 | | - |

| | | |
|---|---|---|
| 债券投资收益 | 7.4.7.11 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.12 | - |
| 贵金属投资收益 | | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.13 | - |
| 股利收益 | 7.4.7.14 | 714,392.09 |
| 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） | 7.4.7.15 | 630,683.16 |
| 4.汇兑收益（损失以“一”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | 623,229.03 |
| **减：二、营业总支出** | | **174,713.93** |
| 1．管理人报酬 | | 97,103.89 |
| 其中：暂估管理人报酬（若有） | | - |
| 2．托管费 | | 19,420.88 |
| 3．销售服务费 | | - |
| 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 | 7.4.7.17 | - |
| 7．税金及附加 | | - |
| 8．其他费用 | 7.4.7.18 | 58,189.16 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | **8,095,138.99** |
| 减：所得税费用 | | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | **8,095,138.99** |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | **-** |
| **六、综合收益总额** | | **8,095,138.99** |

## 7.3 净资产变动表

会计主体：博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 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 | 308,791,913.00 | - | 308,791,913.00 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -303,000,000.00 | 1,924,418.69 | -301,075,581.31 |
| （一）、综合收益总额 | - | 8,095,138.99 | 8,095,138.99 |
| （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） | -303,000,000.00 | -6,170,720.30 | -309,170,720.30 |
| 其中：1.基金申购款 | 26,000,000.00 | 3,884,342.31 | 29,884,342.31 |
| 2.基金赎回款 | -329,000,000.00 | -10,055,062.61 | -339,055,062.61 |
| （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 | 5,791,913.00 | 1,924,418.69 | 7,716,331.69 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金(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]28 号《关于准予博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 308,765,000.00 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_A14 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 6 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 308,791,913.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 26,913.00 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，基金托管人为国泰海通证券股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2025]638 号核准，本基金于 2025 年 6 月 30 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于依法发行上市的非成份股（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票和存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、国债期货、股指期货、股票期权、货币市场工具（包括银行存款、同业存单等）、债券回购、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。未来在法律法规允许的前提下，本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；本基金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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、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：标的指数收益率，即国证大盘成长指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2026 年 3 月 27 日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信

息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）起至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控

制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

**7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息

支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

**7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

**7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

**7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

**7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额

的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（4）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（5）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

（6）公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额形成的应计入当期损益的利得或损失；

（7）其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

**7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

**7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 0.01%以上时，可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

**7.4.4.12 分部报告**

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

（2）能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

（3）能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，对于流通受限股票、出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况的上市股票、在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间债券市场交易的固定收益品种、基金投资，本基金根据具体情况分别按照《关于发布＜证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）＞的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》、《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》、《关于固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布＜基金中基金估值业务指引（试行）＞的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》提供的估值方法进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

（1） 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2） 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得

的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

根据财政部、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》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3） 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4） 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 126,651.61 |
| 等于：本金 | 126,597.49 |
| 加：应计利息 | 54.12 |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 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 | - |
| 合计 | 126,651.61 |

**7.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 6,911,875.41 | - | 7,542,558.57 | 630,683.16 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 6,911,875.41 | - | 7,542,558.57 | 630,683.16 |

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

无余额。

**7.4.7.4 买入返售金融资产**

**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无余额。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无余额。

**7.4.7.5 其他资产**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 应收利息 | - |
| 其他应收款 | 41,751.52 |
| 待摊费用 | - |
| 合计 | 41,751.52 |

**7.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |

| | |
|---|---|
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | - |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 7,054.79 |
| 应付 IOPV 计算与发布费 | 4,985.89 |
| 合计 | 12,040.68 |

**7.4.7.7 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 308,791,913.00 | 308,791,913.00 |
| 本期申购 | 26,000,000.00 | 26,000,000.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -329,000,000.00 | -329,000,000.00 |
| 本期末 | 5,791,913.00 | 5,791,913.00 |

注：1.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)。

2.基金合同于 2025 年 6 月 18 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 308,791,913.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 26,913.00 份基金份额。

**7.4.7.8 未分配利润**

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 |
|---|---|---|---|
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 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 | - | - | - |
| 本期利润 | 7,464,455.83 | 630,683.16 | 8,095,138.99 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -5,193,485.98 | -977,234.32 | -6,170,720.30 |
| 其中：基金申购款 | 3,102,950.58 | 781,391.73 | 3,884,342.31 |
| 基金赎回款 | -8,296,436.56 | -1,758,626.05 | -10,055,062.61 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 2,270,969.85 | -346,551.16 | 1,924,418.69 |

**7.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 17,872.27 |
| 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 | 6,877.87 |
| 其他 | - |
| 合计 | 24,750.14 |

**7.4.7.10 股票投资收益**

**7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 1,993,601.59 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | 4,283,196.91 |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | 6,276,798.50 |

**7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 212,459,684.56 |
| 减：卖出股票成本总额 | 210,257,837.25 |
| 减：交易费用 | 208,245.72 |
| 买卖股票差价收入 | 1,993,601.59 |

**7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 赎回基金份额对价总额 | 339,055,062.61 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 186,298,924.61 |
| 减：赎回股票成本总额 | 148,472,941.09 |
| 减：交易费用 | - |
| 赎回差价收入 | 4,283,196.91 |

**7.4.7.11 债券投资收益**

**7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

无发生额。

**7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

无发生额。

**7.4.7.12 资产支持证券投资收益**

**7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

无发生额。

**7.4.7.12.2 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。

**7.4.7.13 衍生工具收益**

**7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无发生额。

**7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无发生额。

**7.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 714,392.09 |
| 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 | 714,392.09 |

**7.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 630,683.16 |
| ——股票投资 | 630,683.16 |
| ——债券投资 | - |
| ——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 | 630,683.16 |

**7.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | - |
| 替代损益 | 623,229.03 |
| 合计 | 623,229.03 |

**7.4.7.17 信用减值损失**

无发生额。

**7.4.7.18 其他费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 7,054.79 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 中登注册登记费 | 45,748.48 |
| IOPV 计算与发布费 | 4,985.89 |
| 开户费 | 400.00 |
| 合计 | 58,189.16 |

注：自 2025 年 9 月 29 日至 2025 年 12 月 31 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。

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**

**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

**7.4.8.2 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。

**7.4.9 关联方关系**

| 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 |
| 国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”） | 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 |
| 中国长城资产管理股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 浙江省国际贸易集团有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 天津港（集团）有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 浙江省国贸集团资产经营有限公司 | 基金管理人的原股东 |
| 上海汇华实业有限公司 | 基金管理人的股东 |

| | |
|---|---|
| 上海盛业股权投资基金有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 博时资本管理有限公司（“博时资本”） | 基金管理人的子公司 |
| 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 |
| 博时基金（国际）有限公司（“博时国际”） | 基金管理人的子公司 |
| 海南博时创新管理有限公司（“博时创新”） | 基金管理人的子公司 |

注：1.经基金管理人 2024 年第五次临时股东会议决议通过，基金管理人原全资控股的孙公司海南博时创新管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日完成工商变更登记，变更为基金管理人的全资子公司。

2.经基金管理人 2024 年第二次临时股东会议决议，基金管理人原股东浙江省国贸集团资产经营有限公司将其持有的 2%股权转让给浙江省国际贸易集团有限公司。上述股东变更事项已于 2024 年 12 月 24 日完成工商变更登记。

3.国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日完成吸收合并海通证券股份有限公司，并自 2025 年 4 月 3 日起更名为国泰海通证券股份有限公司。

4.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 国泰海通 | 566,746,635.31 | 100.00% |

##### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

无。

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

##### 7.4.10.1.5 基金交易

无。

##### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 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 |
| 国泰海通 | 65,683.97 | 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。

**7.4.10.2 关联方报酬**

**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 97,103.89 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 1,236.70 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 95,867.19 |

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 0.50%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×0.50%/当年天数。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2025 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 19,420.88 |

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。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**7.4.10.4 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**

**7.4.10.4.1 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。

**7.4.10.4.2 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。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**7.4.10.5.2 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**

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 招商证券 | 560,560.00 | 9.68% |

注：1.除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。
2.持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

无。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

无。

**7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**

**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

**7.4.12.2 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 688012 | 中微公司 | 2025-12-19 | 重大事项停牌 | 272.72 | 2026-01-05 | 278.00 | 586.00 | 134,841.25 | 159,813.92 | - |

注：本基金截至 2025 年 12 月 31 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。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪国证大盘成长指数，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紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

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。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格

境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

**7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

**7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**7.4.13.3 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来自调整基金投资组合时，由于组合资产流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用组合证券形式，流动性风险相对较低。

**7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公

开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

###### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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 | 126,651.61 | - | - | - | 126,651.61 |
| 结算备付金 | 23,061.11 | - | - | - | 23,061.11 |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 交易性金融资产 | - | - | - | 7,542,558.57 | 7,542,558.57 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | 41,751.52 | 41,751.52 |
| **资产总计** | **149,712.72** | **-** | **-** | **7,584,310.09** | **7,734,022.81** |
| **负债** | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 4,708.69 | 4,708.69 |
| 应付托管费 | - | - | - | 941.75 | 941.75 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 12,040.68 | 12,040.68 |
| **负债总计** | **-** | **-** | **-** | **17,691.12** | **17,691.12** |
| **利率敏感度缺口** | **149,712.72** | **-** | **-** | **7,566,618.97** | **7,716,331.69** |

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。

**7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

本期末本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资(不包括可转债和可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

**7.4.13.4.2 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。

**7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产－股票投资 | 7,542,558.57 | 97.75 |
| 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 | 7,542,558.57 | 97.75 |

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。

#### 7.4.13.4.3.2 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）<br>本期末<br>2025 年 12 月 31 日 |
| | 业绩比较基准上升 5% | 增加约 41 |
| | 业绩比较基准下降 5% | 减少约 41 |

### 7.4.14 公允价值

#### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 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<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|
| 第一层次 | 7,382,744.65 |
| 第二层次 | 159,813.92 |
| 第三层次 | - |

| | |
|---|---|
| 合计 | 7,542,558.57 |

#### 7.4.14.2.2 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。

### 7.4.14.3 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。

### 7.4.14.4 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。

### 7.4.15 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。

# §8 投资组合报告

## 8.1 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 | 7,542,558.57 | 97.52 |
| | 其中：股票 | 7,542,558.57 | 97.52 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 149,712.72 | 1.94 |
| 8 | 其他各项资产 | 41,751.52 | 0.54 |
| 9 | 合计 | 7,734,022.81 | 100.00 |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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 | 192,300.00 | 2.49 |
| B | 采矿业 | 797,669.50 | 10.34 |
| C | 制造业 | 5,765,608.83 | 74.72 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 157,350.00 | 2.04 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 255,629.00 | 3.31 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 71,240.24 | 0.92 |
| J | 金融业 | 65,985.00 | 0.86 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 31,900.00 | 0.41 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 163,152.00 | 2.11 |
| 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 | 41,724.00 | 0.54 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 7,542,558.57 | 97.75 |

### 8.2.2 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。

## 8.3 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 | 300750 | 宁德时代 | 2,260 | 830,007.60 | 10.76 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 500 | 688,590.00 | 8.92 |
| 3 | 601899 | 紫金矿业 | 13,050 | 449,833.50 | 5.83 |
| 4 | 300308 | 中际旭创 | 700 | 427,000.00 | 5.53 |
| 5 | 300502 | 新易盛 | 800 | 344,704.00 | 4.47 |
| 6 | 002475 | 立讯精密 | 4,100 | 232,511.00 | 3.01 |
| 7 | 300274 | 阳光电源 | 1,300 | 222,352.00 | 2.88 |
| 8 | 002594 | 比亚迪 | 2,200 | 214,984.00 | 2.79 |
| 9 | 688041 | 海光信息 | 803 | 180,201.23 | 2.34 |
| 10 | 002371 | 北方华创 | 375 | 172,155.00 | 2.23 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 11 | 000858 | 五粮液 | 1,600 | 169,504.00 | 2.20 |
| 12 | 603259 | 药明康德 | 1,800 | 163,152.00 | 2.11 |
| 13 | 688012 | 中微公司 | 586 | 159,813.92 | 2.07 |
| 14 | 300476 | 胜宏科技 | 500 | 143,790.00 | 1.86 |
| 15 | 300124 | 汇川技术 | 1,700 | 128,061.00 | 1.66 |
| 16 | 603993 | 洛阳钼业 | 6,100 | 122,000.00 | 1.58 |
| 17 | 600150 | 中国船舶 | 3,500 | 116,410.00 | 1.51 |
| 18 | 601816 | 京沪高铁 | 22,100 | 113,815.00 | 1.47 |
| 19 | 002714 | 牧原股份 | 2,200 | 111,276.00 | 1.44 |
| 20 | 688008 | 澜起科技 | 938 | 110,496.40 | 1.43 |
| 21 | 601857 | 中国石油 | 10,400 | 108,264.00 | 1.40 |
| 22 | 002050 | 三花智控 | 1,900 | 105,089.00 | 1.36 |
| 23 | 300760 | 迈瑞医疗 | 500 | 95,225.00 | 1.23 |
| 24 | 603501 | 豪威集团 | 700 | 88,130.00 | 1.14 |
| 25 | 002463 | 沪电股份 | 1,200 | 87,684.00 | 1.14 |
| 26 | 601600 | 中国铝业 | 7,000 | 85,540.00 | 1.11 |
| 27 | 600660 | 福耀玻璃 | 1,300 | 84,201.00 | 1.09 |
| 28 | 300498 | 温氏股份 | 4,800 | 81,024.00 | 1.05 |
| 29 | 002352 | 顺丰控股 | 2,100 | 80,472.00 | 1.04 |
| 30 | 300014 | 亿纬锂能 | 1,200 | 78,912.00 | 1.02 |
| 31 | 000792 | 盐湖股份 | 2,800 | 78,848.00 | 1.02 |
| 32 | 000568 | 泸州老窖 | 628 | 72,986.16 | 0.95 |
| 33 | 601127 | 赛力斯 | 600 | 72,576.00 | 0.94 |
| 34 | 000100 | TCL 科技 | 15,700 | 71,278.00 | 0.92 |
| 35 | 688111 | 金山办公 | 232 | 71,240.24 | 0.92 |
| 36 | 600809 | 山西汾酒 | 400 | 68,680.00 | 0.89 |
| 37 | 002625 | 光启技术 | 1,400 | 68,264.00 | 0.88 |
| 38 | 600938 | 中国海油 | 2,100 | 63,378.00 | 0.82 |
| 39 | 002460 | 赣锋锂业 | 1,000 | 62,890.00 | 0.82 |
| 40 | 600547 | 山东黄金 | 1,400 | 54,194.00 | 0.70 |
| 41 | 601689 | 拓普集团 | 700 | 54,026.00 | 0.70 |
| 42 | 605499 | 东鹏饮料 | 200 | 53,478.00 | 0.69 |
| 43 | 600436 | 片仔癀 | 300 | 50,634.00 | 0.66 |
| 44 | 600905 | 三峡能源 | 12,000 | 49,080.00 | 0.64 |
| 45 | 600438 | 通威股份 | 2,200 | 45,144.00 | 0.59 |
| 46 | 000625 | 长安汽车 | 3,800 | 45,068.00 | 0.58 |
| 47 | 600760 | 中航沈飞 | 800 | 44,920.00 | 0.58 |
| 48 | 601336 | 新华保险 | 600 | 41,820.00 | 0.54 |
| 49 | 300015 | 爱尔眼科 | 3,800 | 41,724.00 | 0.54 |
| 50 | 002311 | 海大集团 | 700 | 38,766.00 | 0.50 |
| 51 | 600346 | 恒力石化 | 1,600 | 36,048.00 | 0.47 |
| 52 | 600795 | 国电电力 | 7,100 | 35,784.00 | 0.46 |
| 53 | 002179 | 中航光电 | 1,000 | 35,440.00 | 0.46 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 54 | 600415 | 小商品城 | 2,000 | 31,900.00 | 0.41 |
| 55 | 601111 | 中国国航 | 3,400 | 31,858.00 | 0.41 |
| 56 | 600009 | 上海机场 | 900 | 29,484.00 | 0.38 |
| 57 | 600011 | 华能国际 | 3,900 | 29,094.00 | 0.38 |
| 58 | 600886 | 国投电力 | 2,100 | 27,552.00 | 0.36 |
| 59 | 688036 | 传音控股 | 367 | 24,280.72 | 0.31 |
| 60 | 601319 | 中国人保 | 2,700 | 24,165.00 | 0.31 |
| 61 | 601633 | 长城汽车 | 1,000 | 22,630.00 | 0.29 |
| 62 | 688506 | 百利天恒 | 58 | 18,739.80 | 0.24 |
| 63 | 600023 | 浙能电力 | 3,200 | 15,840.00 | 0.21 |
| 64 | 000596 | 古井贡酒 | 100 | 13,260.00 | 0.17 |
| 65 | 603195 | 公牛集团 | 300 | 12,249.00 | 0.16 |
| 66 | 300979 | 华利集团 | 200 | 10,042.00 | 0.13 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 47,941,812.00 | 621.30 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 31,729,989.60 | 411.21 |
| 3 | 601899 | 紫金矿业 | 15,047,137.00 | 195.00 |
| 4 | 002594 | 比亚迪 | 13,353,426.00 | 173.05 |
| 5 | 002371 | 北方华创 | 12,747,337.76 | 165.20 |
| 6 | 688012 | 中微公司 | 11,945,611.65 | 154.81 |
| 7 | 000858 | 五粮液 | 11,310,272.00 | 146.58 |
| 8 | 688041 | 海光信息 | 9,582,607.89 | 124.19 |
| 9 | 688981 | 中芯国际 | 8,847,734.42 | 114.66 |
| 10 | 601816 | 京沪高铁 | 7,720,701.00 | 100.06 |
| 11 | 002475 | 立讯精密 | 7,371,317.00 | 95.53 |
| 12 | 603259 | 药明康德 | 7,356,138.00 | 95.33 |
| 13 | 300760 | 迈瑞医疗 | 7,150,443.00 | 92.67 |
| 14 | 300124 | 汇川技术 | 6,098,756.00 | 79.04 |
| 15 | 600809 | 山西汾酒 | 5,984,376.20 | 77.55 |
| 16 | 688008 | 澜起科技 | 5,509,445.16 | 71.40 |
| 17 | 300308 | 中际旭创 | 5,392,805.00 | 69.89 |
| 18 | 603501 | 豪威集团 | 5,292,641.00 | 68.59 |
| 19 | 601857 | 中国石油 | 5,290,743.00 | 68.57 |
| 20 | 002714 | 牧原股份 | 5,274,925.00 | 68.36 |
| 21 | 601127 | 赛力斯 | 4,917,424.00 | 63.73 |
| 22 | 300502 | 新易盛 | 4,648,608.00 | 60.24 |
| 23 | 600150 | 中国船舶 | 4,474,090.00 | 57.98 |
| 24 | 300274 | 阳光电源 | 4,385,540.00 | 56.83 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 25 | 300498 | 温氏股份 | 4,341,739.00 | 56.27 |
| 26 | 600660 | 福耀玻璃 | 4,216,431.00 | 54.64 |
| 27 | 601919 | 中远海控 | 4,175,301.00 | 54.11 |
| 28 | 000568 | 泸州老窖 | 3,903,131.96 | 50.58 |
| 29 | 000100 | TCL 科技 | 3,839,213.00 | 49.75 |
| 30 | 600938 | 中国海油 | 3,518,616.00 | 45.60 |
| 31 | 601225 | 陕西煤业 | 3,420,197.00 | 44.32 |
| 32 | 600547 | 山东黄金 | 3,235,355.40 | 41.93 |
| 33 | 000792 | 盐湖股份 | 3,166,762.00 | 41.04 |
| 34 | 600905 | 三峡能源 | 3,148,145.00 | 40.80 |
| 35 | 603993 | 洛阳钼业 | 3,059,982.00 | 39.66 |
| 36 | 600436 | 片仔癀 | 2,908,099.00 | 37.69 |
| 37 | 688271 | 联影医疗 | 2,890,241.33 | 37.46 |
| 38 | 601600 | 中国铝业 | 2,865,335.00 | 37.13 |
| 39 | 300014 | 亿纬锂能 | 2,864,967.00 | 37.13 |
| 40 | 600760 | 中航沈飞 | 2,851,264.00 | 36.95 |
| 41 | 000625 | 长安汽车 | 2,808,582.00 | 36.40 |
| 42 | 600089 | 特变电工 | 2,807,873.00 | 36.39 |
| 43 | 688111 | 金山办公 | 2,743,243.26 | 35.55 |
| 44 | 300015 | 爱尔眼科 | 2,723,814.00 | 35.30 |
| 45 | 605499 | 东鹏饮料 | 2,693,301.00 | 34.90 |
| 46 | 002463 | 沪电股份 | 2,685,222.00 | 34.80 |
| 47 | 002050 | 三花智控 | 2,544,937.00 | 32.98 |
| 48 | 688036 | 传音控股 | 2,510,733.70 | 32.54 |
| 49 | 002179 | 中航光电 | 2,465,612.00 | 31.95 |
| 50 | 601336 | 新华保险 | 2,159,730.00 | 27.99 |
| 51 | 600438 | 通威股份 | 2,157,652.00 | 27.96 |
| 52 | 002311 | 海大集团 | 2,135,268.00 | 27.67 |
| 53 | 600009 | 上海机场 | 2,126,414.00 | 27.56 |
| 54 | 600795 | 国电电力 | 2,100,918.00 | 27.23 |
| 55 | 002460 | 赣锋锂业 | 2,097,765.00 | 27.19 |
| 56 | 601689 | 拓普集团 | 1,750,727.00 | 22.69 |
| 57 | 600011 | 华能国际 | 1,712,241.00 | 22.19 |
| 58 | 601633 | 长城汽车 | 1,448,151.00 | 18.77 |
| 59 | 688506 | 百利天恒 | 1,125,095.37 | 14.58 |
| 60 | 300896 | 爱美客 | 1,106,921.60 | 14.35 |
| 61 | 600023 | 浙能电力 | 1,068,029.00 | 13.84 |
| 62 | 000301 | 东方盛虹 | 1,051,825.00 | 13.63 |
| 63 | 600188 | 兖矿能源 | 996,369.00 | 12.91 |
| 64 | 603195 | 公牛集团 | 931,102.20 | 12.07 |
| 65 | 000596 | 古井贡酒 | 899,562.00 | 11.66 |
| 66 | 688223 | 晶科能源 | 849,216.25 | 11.01 |
| 67 | 300476 | 胜宏科技 | 270,755.00 | 3.51 |

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。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 46,778,354.10 | 606.23 |
| 2 | 601899 | 紫金矿业 | 15,576,104.37 | 201.86 |
| 3 | 688012 | 中微公司 | 11,903,956.41 | 154.27 |
| 4 | 688041 | 海光信息 | 9,437,304.29 | 122.30 |
| 5 | 688981 | 中芯国际 | 8,993,919.17 | 116.56 |
| 6 | 603259 | 药明康德 | 7,599,873.97 | 98.49 |
| 7 | 601816 | 京沪高铁 | 7,503,447.00 | 97.24 |
| 8 | 600809 | 山西汾酒 | 5,861,150.00 | 75.96 |
| 9 | 688008 | 澜起科技 | 5,543,072.54 | 71.84 |
| 10 | 603501 | 豪威集团 | 5,177,264.00 | 67.09 |
| 11 | 601857 | 中国石油 | 5,123,247.00 | 66.39 |
| 12 | 601127 | 赛力斯 | 4,842,821.60 | 62.76 |
| 13 | 600150 | 中国船舶 | 4,479,294.00 | 58.05 |
| 14 | 601919 | 中远海控 | 4,154,184.90 | 53.84 |
| 15 | 600660 | 福耀玻璃 | 4,115,877.70 | 53.34 |
| 16 | 600938 | 中国海油 | 3,453,698.00 | 44.76 |
| 17 | 601225 | 陕西煤业 | 3,397,461.00 | 44.03 |
| 18 | 600547 | 山东黄金 | 3,222,323.00 | 41.76 |
| 19 | 603993 | 洛阳钼业 | 3,208,888.00 | 41.59 |
| 20 | 600905 | 三峡能源 | 3,097,852.00 | 40.15 |
| 21 | 600089 | 特变电工 | 2,957,705.60 | 38.33 |
| 22 | 600760 | 中航沈飞 | 2,952,760.00 | 38.27 |
| 23 | 601600 | 中国铝业 | 2,897,001.00 | 37.54 |
| 24 | 688271 | 联影医疗 | 2,872,256.63 | 37.22 |
| 25 | 600436 | 片仔癀 | 2,820,499.97 | 36.55 |
| 26 | 688111 | 金山办公 | 2,691,421.63 | 34.88 |
| 27 | 605499 | 东鹏饮料 | 2,566,810.00 | 33.26 |
| 28 | 688036 | 传音控股 | 2,466,506.92 | 31.96 |
| 29 | 002594 | 比亚迪 | 2,328,987.00 | 30.18 |
| 30 | 600438 | 通威股份 | 2,311,904.00 | 29.96 |
| 31 | 601336 | 新华保险 | 2,107,945.00 | 27.32 |
| 32 | 600009 | 上海机场 | 2,097,947.00 | 27.19 |
| 33 | 600795 | 国电电力 | 2,093,630.00 | 27.13 |
| 34 | 601689 | 拓普集团 | 1,696,357.00 | 21.98 |
| 35 | 600011 | 华能国际 | 1,665,636.00 | 21.59 |
| 36 | 601633 | 长城汽车 | 1,432,020.52 | 18.56 |
| 37 | 300308 | 中际旭创 | 1,341,614.00 | 17.39 |
| 38 | 300502 | 新易盛 | 1,242,325.00 | 16.10 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 39 | 300896 | 爱美客 | 1,107,467.00 | 14.35 |
| 40 | 688506 | 百利天恒 | 1,099,520.59 | 14.25 |
| 41 | 600023 | 浙能电力 | 1,050,630.00 | 13.62 |
| 42 | 600188 | 兖矿能源 | 1,001,404.00 | 12.98 |
| 43 | 603195 | 公牛集团 | 913,519.22 | 11.84 |
| 44 | 688223 | 晶科能源 | 879,420.43 | 11.40 |
| 45 | 000596 | 古井贡酒 | 872,844.00 | 11.31 |
| 46 | 000568 | 泸州老窖 | 320,605.00 | 4.15 |
| 47 | 300274 | 阳光电源 | 316,243.00 | 4.10 |
| 48 | 002311 | 海大集团 | 258,898.00 | 3.36 |

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。

### 8.4.3 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 | 354,286,950.75 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 212,459,684.56 |

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。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，紫金矿业集团股份有限公司在报告编制前一年受到上杭县住房和城乡建设局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券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受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2 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规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。

### 8.12.3 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 | - |
| 6 | 其他应收款 | 41,751.52 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 41,751.52 |

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

# §9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 |
| 382 | 15,162.08 | 1,155,974.00 | 19.96% | 4,635,939.00 | 80.04% |

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 方正证券股份有限公司 | 594,114.00 | 10.26% |
| 2 | 招商证券股份有限公司 | 560,560.00 | 9.68% |
| 3 | 靳玮 | 253,400.00 | 4.38% |
| 4 | 李子豪 | 200,025.00 | 3.45% |
| 5 | 李玉晓 | 162,600.00 | 2.81% |
| 6 | 曲凤垚 | 146,600.00 | 2.53% |
| 7 | 谭晓青 | 144,900.00 | 2.50% |
| 8 | 郭晋智 | 127,700.00 | 2.20% |
| 9 | 钟汉锦 | 125,000.00 | 2.16% |
| 10 | 王波 | 121,900.00 | 2.10% |

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，由于系统字数限制可能有持有人名称显示不全的情况，持有人为场内持有人。

## 9.3 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。

## 9.4 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

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。

# §10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2025 年 6 月 18 日)基金份额总额 | 308,791,913.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 26,000,000.00 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 329,000,000.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 5,791,913.00 |

# §11 重大事件揭示

## 11.1 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。

## 11.2 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 2025 年 10 月 16 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》，张东先生任公司董事长（法定代表人）、代任公司总经理，离任公司总经理。江向阳先生离任公司董事长。

基金管理人于 2025 年 11 月 12 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》，陈宇先生任公司总经理。

报告期内，未发生基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动。

## 11.3 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、基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起，聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金应付审计费为 7054.79 元。

## 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

| 管理人受调查或处罚等情况 | 内容 |
| --- | --- |
| 受到调查或处罚等措施的主体 | 博时基金管理有限公司 |
| 受到调查或处罚等措施的时间 | 2025 年 10 月 31 日 |
| 采取调查或处罚等措施的机构 | 中国证监会深圳监管局 |
| 受到调查或处罚等措施类型 | 行政监管措施 |

| | |
|---|---|
| 受到的具体措施类型 | 责令改正、暂停部分业务 |
| 受到调查或处罚等措施的原因 | 合规内控 |
| 受到处罚的依据 | 《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》、《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 公司已采取完善制度、优化流程、强化监督等措施，全面完成整改工作，已通过整改验收 |
| 其他 | - |

### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

| 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 | 内容 |
|---|---|
| 受到调查或处罚等措施的主体 | 高级管理人员 1；高级管理人员 2 |
| 受到调查或处罚等措施的时间 | 2025 年 10 月 28 日；2025 年 10 月 28 日 |
| 采取调查或处罚等措施的机构 | 中国证监会深圳监管局；中国证监会深圳监管局 |
| 受到调查或处罚等措施类型 | 行政监管措施；行政监管措施 |
| 受到的具体措施类型 | 出具警示函；出具警示函 |
| 受到调查或处罚等措施的原因 | 合规内控；合规内控 |
| 受到处罚的依据 | 《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》；《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 公司已采取完善制度、优化流程、强化监督等措施，全面完成整改工作，已通过整改验收；公司已采取完善制度、优化流程、强化监督等措施，全面完成整改工作，已通过整改验收 |
| 其他 | -；- |

### 11.6.3 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调查或处罚等情况。

### 11.6.4 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调查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 国泰海通 | 3 | 566,746,635.31 | 100.00% | 65,683.97 | 100.00% | 增加 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | 3 个 |

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序

（1）本公司根据法规要求制定《博时基金公募基金证券交易佣金分配管理办法》，明确选择证券公司参与证券交易的标准和程序，并建立证券公司的准入管理机制，符合筛选标准的证券公司可纳入公司证券公司白名单库，并持续动态管理。

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

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国泰海通 | - | - | - | - | - | - |

## 11.8 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 | 博时基金管理有限公司关于暂停使用富友支付提供的快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-12-31 |
| 2 | 关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增世纪证券为申购、赎回代办券商的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-12-08 |
| 3 | 博时基金管理有限公司关于终止北京微动利基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-12-06 |
| 4 | 博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-11-28 |
| 5 | 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 | 2025-11-12 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | 子披露网站 | |
| 6 | 博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 3 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 | 2025-10-28 |
| 7 | 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 | 2025-10-16 |
| 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 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-09-04 |
| 9 | 关于博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金新增东吴证券为申购、赎回代办券商的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-07-04 |
| 10 | 关于博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-30 |
| 11 | 博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金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 | 2025-06-30 |
| 12 | 博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-30 |
| 13 | 博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-25 |
| 14 | 博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-25 |
| 15 | 博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金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 | 2025-06-20 |
| 16 | 博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电 | 2025-06-19 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | 子披露网站 | |
| 17 | 关于博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金提前结束募集的公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-14 |
| 18 | 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-20250606 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-06 |
| 19 | 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-20250603 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-03 |
| 20 | 博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示性公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-03 |
| 21 | 博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金招募说明书 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-05-29 |
| 22 | 博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金托管协议 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-05-29 |
| 23 | 博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-05-29 |
| 24 | 博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-05-29 |
| 25 | 博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要 | 上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-05-29 |

# §12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 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 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持 |
|---|---|---|

| 资者类别 | 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 | 有基金情况 持有份额 | 份额占比 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 机构 | 1 | 2025-12-16~2025-12-16 | - | 11,661,465.00 | 11,067,351.00 | 594,114.00 | 10.26% |
| | 2 | 2025-07-25~2025-09-11;2025-11-12~2025-11-17;2025-11-21~2025-11-23;2025-11-25~2025-12-03;2025-12-08~2025-12-15 | - | 33,111,497.00 | 32,550,937.00 | 560,560.00 | 9.68% |
| 个人 | 3 | 2025-07-25~2025-09-07 | - | 3,015,500.00 | 3,015,500.00 | - | - |
| 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。<br>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.申购份额包含买入份额，赎回份额包含卖出份额。

2.份额占比为四舍五入后的结果。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会批准博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金设立的文件

2、《博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3、《博时国证大盘成长交易型开放式指数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、博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本

6、报告期内博时国证大盘成长交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 13.3 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**

**二〇二六年三月三十一日**