

博远增强回报债券型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:博远基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 28 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年8月26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2026年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
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	7
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	15
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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	48
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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52

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情况	52
§9 开放式基金份额变动	52
§10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
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	54
10.8 其他重大事件	55
§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	58
§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博远增强回报债券型证券投资基金	
基金简称	博远增强回报债券	
基金主代码	008044	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年11月19日	
基金管理人	博远基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	28,307,572.99份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博远增强回报债券A	博远增强回报债券C
下属分级基金的交易代码	008044	008045
报告期末下属分级基金的份额总额	9,167,346.04份	19,140,226.95份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过主动资产配置，在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，力争获取超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例。在资产配置的基础上，通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行积极的债券投资，并主要采取"自下而上"的股票投资策略以增强基金获利能力，力争获取超过业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%
风险收益特征	本基金是债券型基金，其预期收益和风险水平高

	于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。
--	------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博远基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜鹏	许俊
	联系电话	0755-29395888	010-66596688
	电子邮箱	compliance@boyuanfunds.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		0755-29395858	95566
传真		0755-29395889	010-66594942
注册地址		深圳市福田区皇岗路5001号 深业上城T2栋4301室	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		深圳市福田区皇岗路5001号 深业上城T2栋4301室	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		518000	100818
法定代表人		钟鸣远	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.boyuanfunds.com
基金中期报告置备地点	深圳市福田区皇岗路5001号深业上城T2栋4301室

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博远基金管理有限公司	深圳市福田区皇岗路5001号深业上城T2栋4301室

§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01月01日-2026年06月30日)	
	博远增强回报债券 A	博远增强回报债券 C
本期已实现收益	262,178.86	260,272.65
本期利润	301,882.98	346,819.16
加权平均基金份额本期利润	0.0290	0.0299
本期加权平均净值利润率	2.95%	3.11%
本期基金份额净值增长率	2.74%	2.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	-77,009.76	-576,208.21
期末可供分配基金份额利润	-0.0084	-0.0301
期末基金资产净值	9,090,336.28	18,564,018.74
期末基金份额净值	0.9916	0.9699
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	7.36%	4.54%

注：1、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。

2、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、期末可供分配利润，为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。

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

博远增强回报债券A

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	3.75%	0.81%	1.74%	0.14%	2.01%	0.67%
过去六个月	2.74%	0.63%	1.62%	0.12%	1.12%	0.51%
过去一年	6.39%	0.62%	1.98%	0.11%	4.41%	0.51%
过去三年	8.02%	0.55%	7.80%	0.11%	0.22%	0.44%
过去五年	-0.26%	0.52%	7.84%	0.11%	-8.10%	0.41%
自基金合同生效起至今	7.36%	0.49%	12.60%	0.12%	-5.24%	0.37%

博远增强回报债券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	3.64%	0.81%	1.74%	0.14%	1.90%	0.67%
过去六个月	2.54%	0.63%	1.62%	0.12%	0.92%	0.51%
过去一年	5.97%	0.62%	1.98%	0.11%	3.99%	0.51%
过去三年	6.72%	0.55%	7.80%	0.11%	-1.08%	0.44%
过去五年	-2.24%	0.52%	7.84%	0.11%	-10.08%	0.41%
自基金合同生效起至今	4.54%	0.49%	12.60%	0.12%	-8.06%	0.37%

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

博远增强回报债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年11月19日-2026年06月30日)



博远增强回报债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年11月19日-2026年06月30日)



§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

博远基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会证监许可【2018】1920号文批准，于2018年12月12日在深圳注册成立，注册资本1亿元人民币，并于2019年7月1日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。公司目前股东及其出资比

例为：钟鸣远先生45.03%，深圳博远协创投资中心（有限合伙）40%，胡隽先生4.99%，黄军锋先生4.99%，姜俊先生4.99%。截止本报告期末，本基金管理人共管理了8只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
钟鸣远	公司总经理、本基金 基金经理	2019- 11-19	-	29年	钟鸣远先生，中国国籍，毕业于复旦大学金融学专业，经济学硕士学位，具有基金从业资格。现任博远基金管理有限公司总经理。历任国家开发银行深圳分行资金计划部职员，联合证券有限责任公司固定收益部投资经理，泰康人寿保险股份有限公司固定收益策略研究员，新华资产管理股份有限公司固定收益部高级投资经理，易方达基金管理有限公司固定收益总部总经理兼固定收益投资部总经理，大成基金管理有限公司副总经理。2019年11月19日起任博远增强回报债券型证券投资基金基金经理；2020年4月15日至2024年12月27日兼任博远双债增利混合型证券投资基金基金经理；2020年7月8日至2023年7月28日兼任博远博锐混合型

					发起式证券投资基金基金经理；2021年12月13日起兼任博远臻享3个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；2020年9月30日至2023年3月23日兼任博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金基金经理；2021年3月30日至2023年5月16日兼任博远优享混合型证券投资基金基金经理；2022年4月28日至2023年5月16日兼任博远增益纯债债券型证券投资基金基金经理；2023年11月24日起兼任博远增裕利率债债券型证券投资基金基金经理；2024年8月12日起兼任博远增汇纯债债券型证券投资基金基金经理；2025年10月17日起兼任博远增睿纯债债券型证券投资基金基金经理；2026年3月5日起兼任博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
张星	本基金基金经理	2024-01-30	-	11年	张星先生，中国国籍，清华大学工程硕士。曾任深圳前海润泽资产管理有限公司研究员。2019年3月加入博远基金管理有限公司，历任研究部研究员、权益投资总部投资经理、基金经理助理。2024年1月30日起任博

					远增强回报债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---------------------

注：1、基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日。

2、证券从业年限的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益。本报告期内，本基金运作无重大违法、违规行为，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司制度的规定，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节监控交易的公平执行。本基金管理人按日内、3日内、5日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对于因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，由相关投资组合经理出具决策依据，并留存记录备查；对于不同投资组合在不同时间窗口下相邻交易日（1日内、3日内、5日内）的同向交易及反向交易，未发现异常。

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

债券市场方面，2026年上半年整体呈现小幅震荡格局。经济层面，上半年出口保持强劲，基建投资前高后低、二季度逐月回落转负，制造业投资由一季度的稳步增长转为二季度的明显走弱，房地产拖累边际减弱但仍处深度调整，消费整体温和修复但二季度增速持续回落，内需修复基础尚不牢固。物价受多重因素推动超预期回升，PPI于3月份

转正后持续上行，经济修复持续性与通胀演变节奏成为市场博弈焦点。政策层面，广义财政规模可观，实际用于提振投资及促进消费的财政资金增长超6%，新型政策性金融工具加码；货币政策维持“适度宽松”基调，强调相机抉择、精准调控，社会融资成本进入合意区间，短端资金价格平稳低位，为债市提供良好流动性支撑。市场走势方面，10年期国债收益率上半年在1.8%上下窄幅震荡，超长债收益率在一季度末至二季度走出明显上升行情。总的来看，利率中枢在宽货币环境下低位运行，债市配置价值仍存，但需关注PPI持续上行可能带来的政策边际收紧预期。

权益市场方面，2026年上半年呈现宽幅震荡、冲高回落的走势。年初在人民币汇率升值背景下市场情绪偏暖，1-2月监管层有意为市场降温，上证指数于4000-4200点区间震荡；3月受美伊冲突升级、伊朗封闭霍尔木兹海峡及油价飙升影响，市场对滞胀担忧升温，全球主要指数明显回调，上证指数最低触及3800点。二季度市场先扬后抑，4月至5月中旬迎来强劲反弹，上证指数由3900点附近回升至4250点左右并创近年新高；5月中旬特朗普访华结束后，市场转入调整并持续至6月上旬，此后于4000-4200点区间窄幅震荡。

上半年，本基金的债券仓位灵活配置利率债及可转债，利率债保持相对较低的久期和仓位。可转债方面，积极配置资源类和科技类相对低估值的标的，随后在观察到转债市场整体出现高溢价率后，及时降低仓位，有效回避了转债市场后期的大幅回撤。股票操作方面，1月底抓住反弹窗口，净值创出新高，2-3月受市场波动影响出现一定回撤；4月反弹中围绕电子、通讯等板块配置，净值再度创出新高，5-6月随市场调整净值波动加大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末博远增强回报债券A基金份额净值为0.9916元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.74%，同期业绩比较基准收益率为1.62%；截至报告期末博远增强回报债券C基金份额净值为0.9699元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.54%，同期业绩比较基准收益率为1.62%。

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，管理人认为债券市场多空因素交织但总体环境仍偏有利。纯债方面，本基金将持续跟踪宏观经济、政策导向及市场情绪变化，做好久期和仓位管理。可转债方面，随着近期市场整体溢价率的显著回调，转债重新迎来配置机会，下半年将积极运用多种策略参与可转债投资，力争取得更好收益。权益市场方面，AI板块受美韩股市影响，部分资金对明年资本开支的担忧升温，板块出现分歧、分化；传统低位板块开始受到市场资金的关注，但逻辑尚不顺畅。本基金将继续聚焦AI相关的景气赛道，重点关注光芯片、光模块、电子布、存储等方向。另外，本基金也将看好半导体设备板块

及国产算力板块。2026-2028年为半导体行业上行周期，伴随存储厂商大规模扩产，预计2028年半导体设备行业规模将较2025年可能增长翻倍。同时，国内算力需求周期刚刚开启，互联网大厂加量采购趋势明确，持续利好国产算力及上游设备。

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、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，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司基金运营部总经理担任估值委员会主席，权益投资总部、固定收益投资总部、研究部、风险监察部和基金运营部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，来自投资、研究、基金会计和风控等相关岗位。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管人的估值结果核对一致。

本报告期内，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，各方按约定提供银行间同业市场的估值数据和交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人的情形；本基金本报告期内出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会派出机构报告并提出解决方案。

同时，为了减轻本迷你基金的相关固定费用支出给投资者造成的负担，切实保障基金份额持有人的利益，自2024年7月1日起，由基金管理人承担本基金的相关固定费用（包括信息披露费、审计费等）。后续如调整固定费用的承担方式，基金管理人将另行披露。

§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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在博远增强回报债券型证券投资基金（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，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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认真的复核，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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博远增强回报债券型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,430,310.23	2,044,635.11
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	26,260,937.18	21,351,422.30
其中：股票投资		2,984,489.20	1,238,553.74
基金投资		-	-
债券投资		23,276,447.98	20,112,868.56
资产支持证券		-	-

投资			
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		349.73	1,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		27,691,597.14	23,397,057.41
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		20,054.57	-
应付管理人报酬		11,037.98	14,400.60
应付托管费		2,365.27	3,085.84
应付销售服务费		3,254.23	4,428.20
应付投资顾问费		-	-
应交税费		483.72	28.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	46.35	1,000.00
负债合计		37,242.12	22,942.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	28,307,572.99	24,477,817.59

未分配利润	6.4.7.8	-653,217.97	-1,103,703.02
净资产合计		27,654,355.02	23,374,114.57
负债和净资产总计		27,691,597.14	23,397,057.41

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额总额28,307,572.99份，其中博远增强回报债券A类基金份额9,167,346.04份，基金份额净值0.9916元；博远增强回报债券C类基金份额19,140,226.95份，基金份额净值0.9699元。

6.2 利润表

会计主体：博远增强回报债券型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		762,137.06	1,083,686.12
1.利息收入		499.90	1,083.93
其中：存款利息收入	6.4.7.9	499.90	1,083.93
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）		634,079.81	583,830.10
其中：股票投资收益	6.4.7.10	699,633.86	206,829.97
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-73,888.23	361,803.17
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-

股利收益	6.4.7.16	8,334.18	15,196.96
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	126,250.63	497,737.78
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,306.72	1,034.31
减：二、营业总支出		113,434.92	125,023.16
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	74,720.95	81,995.55
2.托管费	6.4.10.2.2	16,011.62	17,570.52
3.销售服务费	6.4.10.2.3	22,385.32	25,345.37
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.税金及附加		237.03	21.72
8.其他费用	6.4.7.19	80.00	90.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		648,702.14	958,662.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		648,702.14	958,662.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		648,702.14	958,662.96

6.3 净资产变动表

会计主体：博远增强回报债券型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	24,477,817.59	-1,103,703.02	23,374,114.57
二、本期期初净资产	24,477,817.59	-1,103,703.02	23,374,114.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,829,755.40	450,485.05	4,280,240.45
（一）、综合收益总额	-	648,702.14	648,702.14
（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）	3,829,755.40	-198,217.09	3,631,538.31
其中：1.基金申购款	11,503,300.24	-322,050.08	11,181,250.16
2.基金赎回款	-7,673,544.84	123,832.99	-7,549,711.85
（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、本期期末净资产	28,307,572.99	-653,217.97	27,654,355.02
项 目	上年度可比期间		
	2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	27,342,782.50	-3,114,483.84	24,228,298.66
二、本期期初净资产	27,342,782.50	-3,114,483.84	24,228,298.66

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,231,952.83	1,186,808.89	-1,045,143.94
（一）、综合收益总额	-	958,662.96	958,662.96
（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）	-2,231,952.83	228,145.93	-2,003,806.90
其中：1.基金申购款	1,860,305.99	-140,845.21	1,719,460.78
2.基金赎回款	-4,092,258.82	368,991.14	-3,723,267.68
（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、本期期末净资产	25,110,829.67	-1,927,674.95	23,183,154.72

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：

钟鸣远	钟鸣远	姚蓝
-----	-----	-----
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博远增强回报债券型证券投资基金(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”)[2019]1762号《关于准予博远增强回报债券型证券投资基金注册的批复》注册，由博远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《博远增强回报债券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，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,094,696,167.73元，

业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0624号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博远增强回报债券型证券投资基金基金合同》于2019年11月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,095,147,732.89份基金份额,其中认购资金利息折合451,565.16份基金份额。本基金的基金管理人为博远基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《博远增强回报债券型证券投资基金基金合同》和《博远增强回报债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购费用、申购费用及销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为博远增强回报债券A;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为博远增强回报债券C。博远增强回报债券A和博远增强回报债券C分别设置代码,分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博远增强回报债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括债券(含国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券)、国内依法发行上市的股票及存托凭证(包括创业板及其他经中国证监会核准上市的股票以及存托凭证)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货等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。

本基金的投资组合比例为:本基金债券的投资比例不低于基金资产的80%;股票及存托凭证资产的投资比例不超过基金资产的20%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率 $\times 90\%$ +沪深300指数收益率 $\times 10\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号——年度报告和中期报告》《证券投资基金会计核算业务指引》《博远增强回报债券型证券投资基金基金合同》

和在财务报表附注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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》和本基金基金合同的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，出现连续一定工作日基金份额持有人数量或者基金资产净值低于某一标准的情形的，基金管理人应当采取相应的处理方案，并于适时向中国证监会报告。于本期末，本基金出现上述情形，本基金的基金管理人已采取后续处理方案，故本财务报表仍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2026年6月30日的财务状况以及自2026年1月1日至2026年6月30日止期间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

本基金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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 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[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》、国务院令第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。

(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。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	47,250.28
等于：本金	47,241.93
加：应计利息	8.35

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	1,383,059.95
等于：本金	1,383,049.14
加：应计利息	10.81
减：坏账准备	-
合计	1,430,310.23

注：其他存款为存放在证券经纪商证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,687,587.73	-	2,984,489.20	296,901.47
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	23,180,859.72	114,951.06	23,276,447.98	-19,362.80
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	23,180,859.72	114,951.06	23,276,447.98	-19,362.80
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		25,868,447.45	114,951.06	26,260,937.18	277,538.67

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	46.35
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
合计	46.35

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 博远增强回报债券A

金额单位：人民币元

项目 (博远增强回报债券A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,411,483.30	11,411,483.30
本期申购	328,293.09	328,293.09
本期赎回（以“-”号填列）	-2,572,430.35	-2,572,430.35

本期末	9,167,346.04	9,167,346.04
-----	--------------	--------------

6.4.7.7.2 博远增强回报债券C

金额单位：人民币元

项目 (博远增强回报债券C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,066,334.29	13,066,334.29
本期申购	11,175,007.15	11,175,007.15
本期赎回（以“-”号填列）	-5,101,114.49	-5,101,114.49
本期末	19,140,226.95	19,140,226.95

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有）；赎回含转换出份额（如有）。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 博远增强回报债券A

单位：人民币元

项目 (博远增强回报债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	60,059.24	-457,342.86	-397,283.62
本期期初	60,059.24	-457,342.86	-397,283.62
本期利润	262,178.86	39,704.12	301,882.98
本期基金份额交易产生的变动数	-58,474.92	76,865.80	18,390.88
其中：基金申购款	3,674.64	-10,310.70	-6,636.06
基金赎回款	-62,149.56	87,176.50	25,026.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	263,763.18	-340,772.94	-77,009.76

6.4.7.8.2 博远增强回报债券C

单位：人民币元

项目 (博远增强回报债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
-------------------	-------	-------	---------

上年度末	-189,263.22	-517,156.18	-706,419.40
本期期初	-189,263.22	-517,156.18	-706,419.40
本期利润	260,272.65	86,546.51	346,819.16
本期基金份额交易产生的变动数	55,850.79	-272,458.76	-216,607.97
其中：基金申购款	101,745.16	-417,159.18	-315,414.02
基金赎回款	-45,894.37	144,700.42	98,806.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	126,860.22	-703,068.43	-576,208.21

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	195.86
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	304.04
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	499.90

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	699,633.86
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	699,633.86

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	24,870,415.02
减：卖出股票成本总额	24,132,461.65
减：交易费用	38,319.51
买卖股票差价收入	699,633.86

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	108,053.24
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-181,941.47
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	-73,888.23

6.4.7.12.2 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01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	195,347,505.69

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	194,312,107.90
减：应计利息总额	1,141,608.68
减：交易费用	75,730.58
买卖债券差价收入	-181,941.47

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	8,334.18
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,334.18

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	126,250.63
——股票投资	210,332.53
——债券投资	-84,081.90
——资产支持证券投资	-
——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	126,250.63

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	1,306.60
转换费收入	0.12
合计	1,306.72

注：1、本基金赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。
2、基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	-
信息披露费	-
汇划手续费	80.00
合计	80.00

注：本报告期内本基金管理人承担了本基金部分基金费用，如审计费用、信息披露费等。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 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

本基金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。

6.4.9.2 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
博远基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
胡隽	基金管理人的股东
姜俊	基金管理人的股东

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至20 26年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至20 25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	74,720.95	81,995.55
其中：应支付销售机构的客户维护费	20,792.10	25,500.10
应支付基金管理人的净管理费	53,928.85	56,495.45

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.70\%\div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

2、客户维护费是指基金管理人及基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026 年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	16,011.62	17,570.52

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 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01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博远增强回报债券A	博远增强回报债券C	合计
博远基金 管理有限 公司	0.00	433.38	433.38
中国银行 股份有限 公司	0.00	16,114.64	16,114.64
合计	0.00	16,548.02	16,548.02
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间		
	2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博远增强回报债券A	博远增强回报债券C	合计
博远基金 管理有限 公司	0.00	0.00	0.00
中国银行 股份有限 公司	0.00	18,194.58	18,194.58
合计	0.00	18,194.58	18,194.58

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。

销售服务费计提的计算公式如下：

$H=E\times0.40\%\div\text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值
 基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

博远增强回报债券A

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	4,838,431.89	4,838,431.89
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	4,838,431.89	4,838,431.89
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	17.09%	19.27%

注：1.基金管理人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.本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金C类份额。

6.4.10.4.2 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

博远增强回报债券A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年06月30日		上年度末 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	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
胡隽	999,657.10	3.53%	999,657.10	4.08%

姜俊	2,255.53	0.01%	2,255.53	0.01%
----	----------	-------	----------	-------

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.本报告期末及上年度末无除基金管理人外其他关联方投资本基金C类份额情况。

6.4.10.5 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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	47,250.28	195.86	44,396.08	144.80

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

除6.4.7.19其他费用中所述管理人承担本基金部分基金费用外，本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金投资的金融工具主要为债券投资，也可择机配置股票资产和存托凭证。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灵活的资产配置和主动的投资管理，拓展大类资产配置空间，在精选个股、个券的基础上适度集中投资，在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期稳健增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由高层监控(董事会下设风险管理委员会、管理层层面设立风险控制委员会)、专业监控(督察长、风险监察部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。

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，及时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。

6.4.13.2 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同责任，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不利变化的风险。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行股份有限公司，因从事证券交易业务和期货交易业务（如有）存放在证券公司和期货公司的结算资金，与其相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的场内交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险很小；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（如适用）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，涉及信用风险的投资品种在入公司备选库前均由信用研究员进行研究支持与风险分析，且基金通过分散化投资以分散信用风险。

于2026年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为51.81%(2025年12月31日：10.28%)。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 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06月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	8,949,951.21	15,866,983.13
合计	8,949,951.21	15,866,983.13

注：于2026年6月30日及2025年12月31日，未评级部分均为国债。债券信用评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	740,241.84	275,073.84
AAA以下	13,586,254.93	2,127,206.66
未评级	-	1,843,604.93
合计	14,326,496.77	4,245,885.43

注：于2025年12月31日，未评级部分为国债。债券信用评级取自第三方评级机构。

6.4.13.3 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一方面来自于基金份额持有人可随时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上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 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》等有关法规的要求建立开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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可能带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注期末“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外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金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，其上限不超过相关法规规定及基金合同约定。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在该类交易约定期限内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债（如有）的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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对本基金面临的利率敏感性缺口进行监测，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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年0 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	1,430,310.23	-	-	-	1,430,310.23
交易性金融资产	23,276,447.98	-	-	2,984,489.20	26,260,937.18
应收申购款	-	-	-	349.73	349.73
资产总计	24,706,758.21	-	-	2,984,838.93	27,691,597.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	20,054.57	20,054.57
应付管理人报酬	-	-	-	11,037.98	11,037.98
应付托管费	-	-	-	2,365.27	2,365.27
应付销售服务费	-	-	-	3,254.23	3,254.23
应交税费	-	-	-	483.72	483.72
其他负债	-	-	-	46.35	46.35
负债总计	-	-	-	37,242.12	37,242.12
利率敏	24,706,758.21	-	-	2,947,596.81	27,654,355.02

感度缺口					
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	2,044,635.11	-	-	-	2,044,635.11
交易性金融资产	18,269,263.63	-	1,843,604.93	1,238,553.74	21,351,422.30
应收申购款	-	-	-	1,000.00	1,000.00
资产总计	20,313,898.74	-	1,843,604.93	1,239,553.74	23,397,057.41
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	14,400.60	14,400.60
应付托管费	-	-	-	3,085.84	3,085.84
应付销售服务费	-	-	-	4,428.20	4,428.20
应交税费	-	-	-	28.20	28.20
其他负债	-	-	-	1,000.00	1,000.00
负债总计	-	-	-	22,942.84	22,942.84
利率敏感度缺口	20,313,898.74	-	1,843,604.93	1,216,610.90	23,374,114.57

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

6.4.13.4.1.2 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：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	市场利率上升25个基点	-105,277.60	-133,574.80
	市场利率下降25个基点	106,441.11	140,926.98

6.4.13.4.2 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，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、存托凭证和债券等，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：本基金债券的投资比例不低于基金资产的80%；同时还可择机进行股票及存托凭证投资，但股票及存托凭证资产的投资比例不超过基金资产的20%。此外，本基金的基金管理人定期或不定期运用压力测试对基金进行风险度量，测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2026年06月30日		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	2,984,489.20	10.79	1,238,553.74	5.30
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	2,984,489.20	10.79	1,238,553.74	5.30

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数收益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：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	沪深300指数收益率上升5%	260,798.59	115,725.17
	沪深300指数收益率下降5%	-260,798.59	-115,725.17

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	17,310,985.97	3,640,834.24
第二层次	8,949,951.21	17,710,588.06
第三层次	-	-
合计	26,260,937.18	21,351,422.30

6.4.14.2.2 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股票和债券，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股票和债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，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025年12月31日：同)。

6.4.14.4 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货币资金、其他各类应收款项和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 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。

§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	2,984,489.20	10.78
	其中：股票	2,984,489.20	10.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	23,276,447.98	84.06
	其中：债券	23,276,447.98	84.06
	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	1,430,310.23	5.17
8	其他各项资产	349.73	0.00
9	合计	27,691,597.14	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,607,666.70	9.43
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	376,822.50	1.36
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	2,984,489.20	10.79

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600176	中国巨石	6,800	495,584.00	1.79
2	688777	中控技术	3,207	376,822.50	1.36
3	301123	奕东电子	3,100	374,232.00	1.35
4	600105	永鼎股份	4,900	330,652.00	1.20
5	688668	鼎通科技	829	309,465.70	1.12
6	605358	立昂微	3,500	271,600.00	0.98
7	603986	兆易创新	300	244,500.00	0.88
8	300903	科翔股份	2,300	233,013.00	0.84
9	002384	东山精密	800	209,880.00	0.76
10	300502	新易盛	200	121,400.00	0.44
11	600183	生益科技	100	17,340.00	0.06

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	300308	中际旭创	1,134,924.00	4.86
2	002384	东山精密	926,041.00	3.96
3	300750	宁德时代	921,988.00	3.94
4	300502	新易盛	850,622.00	3.64
5	300207	欣旺达	780,130.00	3.34
6	002812	恩捷股份	779,444.00	3.33
7	300014	亿纬锂能	763,613.00	3.27
8	688072	拓荆科技	752,323.67	3.22
9	600105	永鼎股份	695,426.00	2.98
10	601600	中国铝业	680,596.00	2.91
11	300274	阳光电源	677,498.00	2.90
12	605358	立昂微	614,797.00	2.63
13	002709	天赐材料	590,250.00	2.53
14	300378	鼎捷数智	577,164.00	2.47
15	301123	奕东电子	568,006.00	2.43
16	688668	鼎通科技	557,105.31	2.38
17	600522	中天科技	548,481.00	2.35
18	688615	合合信息	542,931.07	2.32
19	688630	芯碁微装	440,628.20	1.89
20	301358	湖南裕能	431,328.00	1.85

注：本项中"本期累计买入金额"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	300308	中际旭创	1,404,161.00	6.01
2	300750	宁德时代	946,363.00	4.05
3	002384	东山精密	907,047.00	3.88
4	002812	恩捷股份	829,381.00	3.55
5	688072	拓荆科技	808,437.78	3.46
6	300207	欣旺达	758,873.00	3.25
7	300014	亿纬锂能	736,637.00	3.15
8	300502	新易盛	719,423.00	3.08
9	688668	鼎通科技	717,338.30	3.07
10	300274	阳光电源	636,407.00	2.72
11	601600	中国铝业	613,267.00	2.62
12	688630	芯碁微装	611,979.67	2.62
13	300378	鼎捷数智	586,744.00	2.51
14	002709	天赐材料	565,351.00	2.42
15	688615	合合信息	547,629.39	2.34
16	600522	中天科技	521,143.00	2.23
17	301308	江波龙	484,003.00	2.07
18	603308	应流股份	471,862.00	2.02
19	301358	湖南裕能	427,627.00	1.83
20	603799	华友钴业	400,559.00	1.71

注：本项中"本期累计卖出金额"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

买入股票成本（成交）总额	25,668,064.58
卖出股票收入（成交）总额	24,870,415.02

注：本项"买入股票成本"和"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	8,949,951.21	32.36
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)	14,326,496.77	51.81
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	23,276,447.98	84.17

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	73,000	7,347,318.00	26.57
2	019835	26国债09	16,000	1,602,633.21	5.80
3	118058	微导转债	1,500	818,340.33	2.96
4	123211	阳谷转债	2,560	457,715.24	1.66
5	123076	强力转债	3,060	453,767.15	1.64

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

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 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除金田转债（113046.SH）的发行主体外，没有出现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。

本基金投资的前十名证券之一的金田转债（113046.SH）发行主体宁波金田铜业(集团)股份有限公司因漏税，于2026年1月22日受到海关罚款（甬北关缉违字(2026)122号）。

本基金管理人认为，以上监管措施及处罚不会对其投资价值构成实质性影响。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	349.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	349.73

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值
---	------	------	------	---------

号				比例 (%)
1	118058	微导转债	818,340.33	2.96
2	123211	阳谷转债	457,715.24	1.66
3	123076	强力转债	453,767.15	1.64
4	113046	金田转债	452,170.88	1.64
5	127103	东南转债	446,587.02	1.61
6	118044	赛特转债	446,418.98	1.61
7	123109	昌红转债	445,457.30	1.61
8	127095	广泰转债	444,927.61	1.61
9	123183	海顺转债	444,715.97	1.61
10	113636	甬金转债	444,496.67	1.61
11	127034	绿茵转债	443,958.70	1.61
12	110090	爱迪转债	443,542.18	1.60
13	123209	聚隆转债	443,400.70	1.60
14	123080	海波转债	441,206.66	1.60
15	127040	国泰转债	441,175.68	1.60
16	118039	煜邦转债	440,804.37	1.59
17	123237	佳禾转债	440,762.67	1.59
18	113695	华辰转债	440,704.47	1.59
19	113649	丰山转债	440,484.07	1.59
20	123222	博俊转债	437,753.71	1.58
21	127082	亚科转债	437,117.81	1.58
22	118012	微芯转债	436,849.70	1.58
23	123088	威唐转债	436,328.95	1.58
24	113652	伟22转债	435,930.13	1.58
25	113058	友发转债	435,599.89	1.58
26	123150	九强转债	435,500.14	1.57
27	110099	福能转债	433,914.52	1.57
28	123065	宝莱转债	433,858.34	1.57
29	113646	永吉转债	433,264.77	1.57
30	110073	国投转债	410,235.56	1.48

31	123235	亿田转债	398,120.20	1.44
32	127084	柳工转2	330,006.28	1.19
33	118036	力合转债	1,380.12	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§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
博远 增强 回报 债券A	124	73,930.21	4,838,603.96	52.7 8%	4,328,742.08	47.22%
博远 增强 回报 债券C	301	63,588.79	14,789,470.21	77.2 7%	4,350,756.74	22.73%
合计	412	68,707.70	19,628,074.17	69.3 4%	8,679,498.82	30.66%

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博远增强回报债券A	1,007,813.32	10.99%
	博远增强回报债券C	4,247.64	0.02%
	合计	1,012,060.96	3.58%

注：上述基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博远增强回报债券A	0~10
	博远增强回报债券C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	博远增强回报债券A	0~10
	博远增强回报债券C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	博远增强回报债券A	博远增强回报债券C
基金合同生效日(2019年11月19日)基金份额总额	817,346,168.11	277,801,564.78
本报告期期初基金份额总额	11,411,483.30	13,066,334.29

本报告期基金总申购份额	328,293.09	11,175,007.15
减：本报告期基金总赎回份额	2,572,430.35	5,101,114.49
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	9,167,346.04	19,140,226.95

注：总申购份额含红利再投（如有）、转换入份额（如有）；总赎回份额含转换出份额（如有）。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开过基金份额持有人大会，无相关决议。

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

1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，经本基金管理人2026年第一次股东会及第三届董事会第三次会议审议通过，董事长胡隽先生于2026年4月3日离任公司董事及董事长职务，总经理钟鸣远先生代为履行董事长职务。前述事项已按要求完成了监管备案及信息披露公告。

本报告期内，经本基金管理人2026年公司第三届董事会第四次会议审议通过，钟鸣远先生于2026年4月15日任公司财务负责人，同时姜俊先生不再担任公司财务负责人。前述事项已按要求完成了监管备案及信息披露公告。

2、基金托管人的重大人事变动

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘会计师事务所的情况。

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，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

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，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

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，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

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	
联储证券	2	50,538,479.60	100.00%	86,984.02	100.00%	-

注：1、本基金采用委托券商交易模式。

2、本基金管理人负责选择提供经纪服务的券商，主要选择标准包括：券商的基本面评价（财务状况稳健、经营行为规范、无重大负面舆情等）、服务评价（交易稳定性、系统及线路稳定性、交易反馈及时性、清算数据准确性等）、研究服务质量评价（即在其他条件相同或相近的情况下，优先选择研究服务更优的券商）等。

3、选择程序：公司根据上述选择标准，对拟合作的券商展开综合考察和评估，将经评估符合标准的券商纳入公司结算券商备选库，并每年进行一次回检。与最后选定的券商签订证券经纪服务协议，明确双方的权利和义务。

4、报告期内，本基金未有新增或停止使用专用交易单元的情况。

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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
联储证券	374,830,488.00	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博远基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京加和基金销售有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2026-01-13
2	博远增强回报债券型证券投资基金2025年第4季度报告	规定媒介	2026-01-22
3	博远基金管理有限公司旗下基金2025年第4季度报告提示性公告	规定媒介	2026-01-22
4	博远基金管理有限公司关于旗下部分基金增加大河财富基金销售有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2026-02-27
5	博远基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海证达通基金销售有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2026-03-17
6	博远增强回报债券型证券投资基金2025年年度报告	规定媒介	2026-03-31
7	博远基金管理有限公司旗下基金2025年年度报告提示性公告	规定媒介	2026-03-31
8	博远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	规定媒介	2026-03-31

	年度)		
9	博远基金管理有限公司旗下基金2025年年度报告提示性公告更正公告	规定媒介	2026-04-01
10	博远基金管理有限公司关于总经理代为履行董事长职务的公告	规定媒介	2026-04-04
11	博远基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海国信嘉利基金销售有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2026-04-13
12	博远基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定媒介	2026-04-16
13	博远基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金产品风险等级划分结果的公告	规定媒介	2026-04-18
14	博远基金管理有限公司旗下基金2026年第1季度报告提示性公告	规定媒介	2026-04-21
15	博远增强回报债券型证券投资基金2026年第1季度报告	规定媒介	2026-04-21
16	关于提醒投资者防范不法分子冒用“博远基金”名义进行诈骗的风险提示	规定媒介	2026-04-24
17	2025年度博远基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	规定媒介	2026-04-30
18	博远基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及完善身份信息资料的公告	规定媒介	2026-05-14

19	关于博远增强回报债券型证券投资基金招募说明书和基金产品资料概要更新的提示性公告	规定媒介	2026-05-30
20	博远增强回报债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	规定媒介	2026-05-30
21	博远增强回报债券型证券投资基金招募说明书更新（2026年第1号）	规定媒介	2026-05-30
22	博远增强回报债券型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	规定媒介	2026-05-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260120-20260625	4,838,431.89	-	-	4,838,431.89	17.09%
	2	20260626-20260630	-	10,289,124.40	-	10,289,124.40	36.35%
产品特有风险							
(1) 不能及时应对赎回的风险 持有份额比例较高的基金份额持有人（以下简称“高比例投资者”）大额赎回时，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。 (2) 基金净值大幅波动的风险 当高比例投资者大量赎回时，基金管理人为支付赎回款项而变现基金资产，可能造成资产价格波动，导致本基金资产净值发生波动。若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。若高比例投资者大量赎回本基金，计算基金份额净值时进行四舍五入也可能引起基金份额净值发生波动。 (3) 基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。 (4) 基金面临转型、合并或提前终止的风险 高比例投资者赎回后，可能会导致出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。							

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、中国证监会批准博远增强回报债券型证券投资基金注册的文件；
- 2、《博远增强回报债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博远增强回报债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《博远增强回报债券型证券投资基金招募说明书》及其更新；
- 5、博远基金管理有限公司业务资格批准文件、营业执照；
- 6、本报告期内本基金在符合中国证监会规定条件的全国性报刊上披露的各项公告原件。

12.2 存放地点

深圳市福田区皇岗路5001号深业上城T2栋4301室博远基金管理有限公司

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人住所免费查询，或登录中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund/>）及基金管理人网站（<http://www.boyuanfunds.com>）查阅。

博远基金管理有限公司
二〇二六年八月二十八日