

博时中证银行交易型开放式指数证券投资 基金

2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十一日

§1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时中证银行 ETF
场内简称	银行 ETF 博时
基金主代码	159253
交易代码	159253
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 11 月 27 日
报告期末基金份额总额	623,304,979.00 份
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。 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，即中证银行指数收益率。
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，跟踪中证银行指数，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。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	4,986,058.43
2.本期利润	-40,362,528.87
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0900
4.期末基金资产净值	544,574,709.25
5.期末基金份额净值	0.8737

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

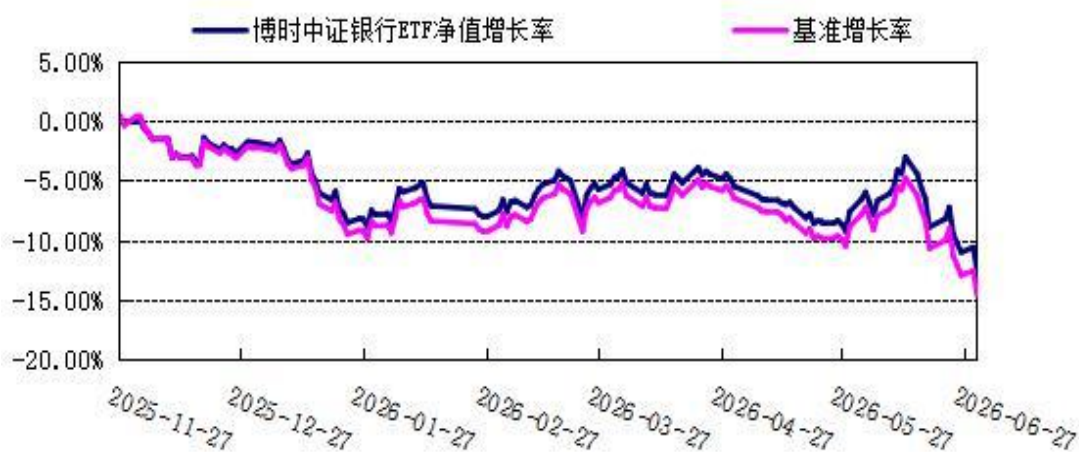
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.37%	0.93%	-9.37%	0.93%	1.00%	0.00%
过去六个月	-11.11%	0.91%	-12.74%	0.93%	1.63%	-0.02%
自基金合同生 效起至今	-12.63%	0.86%	-14.58%	0.89%	1.95%	-0.03%

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



注：本基金的基金合同于 2025 年 11 月 27 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵云阳	指数与量化投资部	2025-11-27	-	15.8	赵云阳先生，硕士。2003 年至 2010 年在晨星中国研究

	投资总监/ 基金经理				中心工作。2010 年加入博时基金管理有限公司。历任量化分析师、量化分析师兼基金经理助理、博时特许价值混合型证券投资基金(2013 年 9 月 13 日-2015 年 2 月 9 日)、博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金(2015 年 4 月 29 日-2016 年 5 月 30 日)、博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2015 年 5 月 4 日-2016 年 5 月 30 日)、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2015 年 5 月 5 日-2016 年 5 月 30 日)、上证企债 30 交易型开放式指数证券投资基金(2013 年 7 月 11 日-2018 年 1 月 26 日)、深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金(2012 年 11 月 13 日-2018 年 12 月 10 日)、博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2012 年 11 月 13 日-2018 年 12 月 10 日)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金(2018 年 12 月 10 日-2019 年 10 月 11 日)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2018 年 12 月 10 日-2019 年 10 月 11 日)、博时中证银行指数分级证券投资基金(2015 年 10 月 8 日-2020 年 8 月 5 日)、博时中证 800 证券保险指数分级证券投资基金(2015 年 5 月 19 日-2020 年 8 月 6 日)的基金经理、指数与量化投资部投资副总监、博时中证全指证券公司指数证券投资基金(2020 年 8 月 7 日-2025 年 12 月 2 日)、博时中证银行指数证券投资基金(LOF)
--	---------------	--	--	--	--

					(2020 年 8 月 6 日-2026 年 4 月 29 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资总监兼博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时黄金交易型开放式证券投资基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时黄金交易型开放式证券投资基金联接基金(2016 年 5 月 27 日—至今)、博时中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金(2018 年 10 月 19 日—至今)、博时中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2018 年 11 月 14 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 9 月 20 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019 年 11 月 13 日—至今)、博时中证医药 50 交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 7 月 22 日—至今)、博时创业板 50 指数型证券投资基金(2025 年 9 月 15 日—至今)、博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 10 月 24 日—至今)、博时中证银行交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 11 月 27 日—至今)、博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2025 年 12 月 3 日—至今)、博时中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2026 年 4 月 30 日—至今)
--	--	--	--	--	--

					今)的基金经理。
--	--	--	--	--	----------

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 10 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年二季度，中国经济延续结构性分化格局，“稳中求进”政策基调下总量名义企稳，但内外分化与再通胀成为新的主线特征。生产端保持韧性，工业与高技术制造仍是重要支撑。价格端出现明显变化，受海外地缘冲突影响，PPI 呈现“再通胀”特征，PPI 同比、环比连续为正；CPI 同比稳定在 1% 以上，通胀温和。需求端则边际转弱，社会消费品零售总额同比下滑，内需修复动能不足；民间投资累计同比降幅走阔，社融增量同比下降，信用扩张偏弱。出口维持较强韧性，延续高景气。货币政策保持“适度宽松”，财政与货币协同托底。海外方面，美伊冲突成为主导全球资产的核心变量。二季度前期，霍尔木兹海峡封锁，国际油价冲高，随着美伊局势边际缓和，原油高位震荡回落，外部流动性压力阶段性释放。政策上，美联储在通胀韧性与油价扰动下转向谨慎，全球流动性阶段性收紧。同时，海外 AI 产业趋势延续高景气，与国内 AI 产业链形成共振。

A 股二季度呈现"先抑后扬、结构致胜"格局。一季度末在美伊冲突催化下，避险情绪升温、市场承压，进入 4 月后，随着外部扰动减退、油价回落及一季报收官，全 A 盈利增速回暖，市场转入景气驱动的结构行情，呈现"科技领涨、指数震荡抬升"格局，AI 算力等高景气赛道获资金集中增配。本基金为被动跟踪指数的基金，其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差，取得标的指数所代表的市场平均回报。

展望三季度，国内"稳中求进"的政策基调延续，AI 产业趋势与部分周期涨价链构成结构性亮点，但内需偏弱、信用扩张不足与地产消费的修复仍需政策进一步发力，名义企稳与政策协同仍是主线。银行板块基本面预计延续量价改善与分化并存格局，受益化债与地产企稳但需关注弱资质区域及零售不良风险，红利属性仍具配置价值。本基金作为一只被动策略的指数基金，会以最小化跟踪误差为目标，紧密跟踪标的指数。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 0.8737 元，份额累计净值为 0.8737 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-8.37%，同期业绩基准增长率为-9.37%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	535,359,119.37	97.94
	其中：股票	535,359,119.37	97.94
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	11,173,691.14	2.04
8	其他各项资产	60,492.63	0.01
9	合计	546,593,303.14	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	101,441.32	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	535,257,678.05	98.29
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	535,359,119.37	98.31

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	2,250,484	79,892,182.00	14.67
2	601166	兴业银行	3,174,800	52,574,688.00	9.65
3	601398	工商银行	6,059,000	42,837,130.00	7.87
4	601288	农业银行	5,387,500	32,702,125.00	6.01
5	601328	交通银行	4,996,600	32,128,138.00	5.90
6	600919	江苏银行	2,755,200	29,701,056.00	5.45
7	600000	浦发银行	2,498,809	21,514,745.49	3.95
8	002142	宁波银行	619,000	18,378,110.00	3.37
9	000001	平安银行	1,817,100	18,261,855.00	3.35
10	601229	上海银行	1,865,100	16,189,068.00	2.97

5.4 报告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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行、国家外汇管理局上海市分局、国家外汇管理局吉林省分局、国家外汇管理局苏州市分局、金融监管总局的处罚。上海银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行、国家金融监督管理总局上海监管局的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行辽宁省分行、国家外汇管理局安徽省分局、国家税务总局白银市税务局稽查局、金融监管总局的处罚。中国工商银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局、国家税务总局兰州市税务局稽查局、深圳市市场监督管理局(深圳市知识产权局)、深圳金融监管局、西安市新城区城市管理和综合执法局、金融监管总局的处罚，在报告编制前一年受到中国人民银行衢州市分行的通报批评。交通银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行、国家外汇管理局湖北省分局、国家金融监督管理总局上海监管局、金融监管总局的处罚，在报告编制前一年受到中国人民银行威海市分行、中国人民银行山东省分行的通报批评。兴业银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行广东省分行、国家外汇管理局北京市分局、宁德市市场监督管理局、金融监管总局的处罚。宁波银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行宁波市分行、国家金融监督管理总局衢州监管分局的处罚。平安银行股份有限公司在报告编制前一年受

到中国人民银行福建省分行、金融监管总局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行安徽省分行、国家外汇管理局内蒙古自治区分局、浙江金融监管局、金融监管总局的处罚，在报告编制前一年受到中国人民银行山东省分行的通报批评。江苏银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行北京市分行、常州市市场监督管理局、无锡金融监管分局的处罚。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。

5.11.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	60,492.63

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	95,304,979.00
报告期期间基金总申购份额	640,800,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	112,800,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	623,304,979.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

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
中国建设银行股份有限公司—博时中证银行交易型	1	2026-05-07~2026-06-30	-	606,000,000.00	77,000,000.00	529,000,000.00	84.87%

开 放 指 数 证 券 投 资 基 金 联 接 基 金							
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

注：1.申购份额包含买入份额，赎回份额包含卖出份额。

2.份额占比为四舍五入后的结果。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时中证银行交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 2、《博时中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《博时中证银行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、报告期内博时中证银行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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二六年七月二十一日