

**博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金
2025 年中期报告
2025 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月二十九日

§ 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，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
§4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
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	9
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	11
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	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	34
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	35
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	35
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	35
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	35
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	35
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	35
7.12 投资组合报告附注	36
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末上市基金前十名持有人	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.4 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	46
§9 开放式基金份额变动	46

§ 10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时可转债 ETF
场内简称	可转债 ETF
基金主代码	511380
交易代码	511380
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 6 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,977,186,670.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 4 月 7 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	<p>本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。本基金将采用抽样复制法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、流动性、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性等情况，进行抽样优化调整，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。</p> <p>本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。对于出现市场流动性不足、因法律法规原因被限制投资等情况，导致本基金无法获得对个别成份券足够数量的投资时，基金管理人将通过投资其他成份券、非成份券、成份券个券衍生品等方式进行替代。其他投资策略包括固定收益品种投资策略，含利率策略、骑乘策略、放大策略、其他金融工具投资策略以及国债期货投资策略等。</p>
业绩比较基准	中证可转债及可交换债券指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金采用优化抽样复制策略，跟踪中证可转债及可交换债券指数，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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼
	联系电话	0755-83169999
	电子邮箱	service@bosera.com
客户服务电话	95105568	400-61-95555
传真	0755-83195140	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦

邮政编码	518040	518040
法定代表人	江向阳	缪建民

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	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
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（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益		1,339,763,673.61
本期利润		2,521,261,537.21
加权平均基金份额本期利润		0.8104
本期加权平均净值利润率		6.78%
本期基金份额净值增长率		6.93%
3.1.2 期末数据和指标		报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润		6,328,060,029.67
期末可供分配基金份额利润		2.1255
期末基金资产净值		36,923,997,242.01
期末基金份额净值		12.4023
3.1.3 累计期末指标		报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率		24.02%

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

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

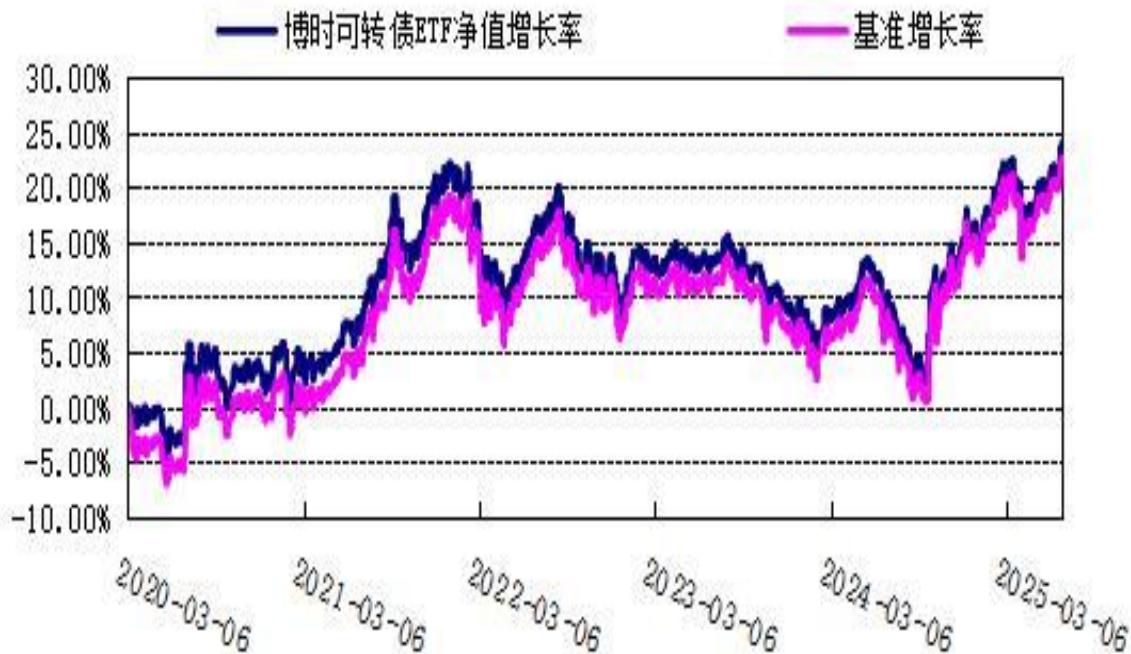
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长 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
过去一个月	3.18%	0.33%	3.33%	0.33%	-0.15%	0.00%
过去三个月	3.60%	0.64%	3.80%	0.65%	-0.20%	-0.01%
过去六个月	6.93%	0.56%	7.01%	0.57%	-0.08%	-0.01%

过去一年	12.81%	0.65%	13.59%	0.66%	-0.78%	-0.01%
过去三年	6.42%	0.51%	7.27%	0.51%	-0.85%	0.00%
自基金合同生效起至今	24.02%	0.55%	22.79%	0.55%	1.23%	0.00%

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



§ 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 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 394 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 16,069 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 6,729 亿元人民币，累计分红逾 2,186 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
高晖	基金经理	2023-10-20	-	14.2	高晖先生，硕士。2011 年加入博时基金管理有限公司。现任博时转债

					增强债券型证券投资基金(2023年10月20日—至今)、博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金(2023年10月20日—至今)、博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)(2023年10月20日—至今)的基金经理。
过钧	首席基金经理 /基金经理	2023-09-15	-	23.9	过钧先生，硕士。1995年起先后在上海工艺品进出口公司、德国德累斯顿银行上海分行、美国Lowes食品有限公司、美国通用电气公司、华夏基金固定收益部工作。2005年加入博时基金管理有限公司。历任博时稳定价值债券投资基金(2005年8月24日-2010年8月4日)基金经理、固定收益部副总经理、博时转债增强债券型证券投资基金(2010年11月24日-2013年9月25日)、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金(2013年2月1日-2014年4月2日)、博时裕祥分级债券型证券投资基金(2014年1月8日-2014年6月10日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2013年9月13日-2015年7月16日)、博时新财富混合型证券投资基金(2015年6月24日-2016年7月4日)、博时新机遇混合型证券投资基金(2016年3月29日-2018年2月6日)、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金(2016年8月1日-2018年2月6日)、博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)(2014年6月10日-2018年4月23日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2016年10月24日-2018年5月5日)、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月10日-2018年5月21日)、博时鑫和灵活配置混合型证券投资基金(2017年12月13日-2018年6月16日)、博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金(2017年1月10日-2018年7月30日)的基金经理、固定收益总部公募基金组负责人、博时新价值灵活配置混合型证券投资基金(2016年3月29日-2019年4月30日)、博时乐臻定期开放混合型证券投资基金(2016年9月29日-2019年10月14日)、博时转债增强债券型证券投资基金(2019年1月28日-2020年4月3日)、博时鑫源灵活

					配置混合型证券投资基金(2016年9月6日-2020年7月20日)、博时新起点灵活配置混合型证券投资基金(2016年10月17日-2020年7月20日)、博时鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月10日-2020年7月20日)、博时中债3-5年国开行债券指数证券投资基金(2019年7月19日-2020年10月26日)的基金经理、固定收益总部指数与创新组负责人、公司董事总经理、博时中债3-5年进出口行债券指数证券投资基金(2018年12月25日-2021年8月17日)基金经理。现任首席基金经理兼博时信用债券投资基金(2009年6月10日—至今)、博时新收益灵活配置混合型证券投资基金(2016年2月29日—至今)、博时双季鑫6个月持有期混合型证券投资基金(2021年1月20日—至今)、博时浦惠一年持有期混合型证券投资基金(2022年2月17日—至今)、博时恒耀债券型证券投资基金(2022年11月10日—至今)、博时信享一年持有期混合型证券投资基金(2023年3月8日—至今)、博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金(2023年9月15日—至今)、博时转债增强债券型证券投资基金(2023年9月15日—至今)、博时匠心优选混合型证券投资基金(2024年4月25日—至今)的基金经理。
范卓宇	基金经理助理	2025-03-06	-	6.9	范卓宇先生，硕士。2018年起先后在国泰君安证券、广发证券工作。2023年加入博时基金管理有限公司。现任基金经理助理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 23 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

上半年受海内外多重因素交织影响，权益市场走势震荡上行，整体呈“N型”走势。年初至3月国内AI产业加速发展与政策暖风共振，市场震荡上行；3月下旬至4月上旬，受特朗普“对等关税”影响，市场震荡调整；4月中旬至年中，国内政策积极发力，叠加中美贸易摩擦阶段性缓和，市场震荡回升。期间，沪深300指数上涨0.03%，万得全A指数上涨5.83%。债券市场上半年整体呈现震荡格局，一季度由于海外方面对汇率造成了一定制约，使得资金面整体未能继续维持宽松态势，货币政策上也没有进一步的放松，最终导致债券市场整体面临调整。进入二季度之后，美方单方面发起的贸易战短时间引发市场波动，长周期利率品种在短短几个交易日内收益率有较为明显的下行，但随后又进入到了窄幅波动的状态。信用类资产在二季度由于配置力量较强，且各类ETF的发行也增强了相关成分标的的流动性，推动了二季度信用利差的逐步压缩，在二季度的后两个月体现为信用债表现强于利率债。上半年整体来看，10年期国债收益率小幅下行3bps，30年期国债收益率下行5bps。

转债方面，上半年整体贡献了较好的正回报，在泛固收类资产中表现突出，中证转债及可交换债指数上涨7.01%，万得可转债等权指数上涨9.11%，AA-及以下评级转债领跑。相较债券和股票宽基而言均显著跑赢，一方面，转债正股整体相较股票宽基表现更好，从转债市场结构来看，银行和电力设备构成两大权重行业，其余多数为中小市值个股，受益于流动性驱动的市场主题行情和中小盘风格。另一方面，转债市场估值显著提升，今年以来转债供给偏紧，低利率环境下，纯债收益相对有限，资金配置转债需求仍强，转债估值修复至历史较高水平。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金，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。在本报告期内我们严格按照基金合同要求，力求组合成份券紧密跟踪指数，并结合主动研究分析，在控制跟踪误差有效范围内对价格极度虚高的少数个券进行有效替代，及时剔除存在退市、信用风险的个券，并在最小化交易成本的同时适时调仓，尽可能地减少跟踪误差。同时，在本报告期我们严格按照基金合同要求，尽量降低成本、减少市场冲击，调整组合与目标指数的结构基本一致。上半年可转债ETF规模保持平稳，二级成交额继续提升，交易活跃度保持良好发展态势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 12.4023 元，份额累计净值为 1.2402 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 6.93%，同期业绩基准增长率 7.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益市场整体呈现基本面磨底、政策呵护、流动性充裕的特征。从全年维度来看，政策期权清晰，但传导至 PPI 和上市公司盈利仍需进一步等待。预计 PPI 下半年中枢为负，仍显著压制上市公司毛利率，关注下半年政策对冲力度。从估值角度，目前股债收益差处于 -1x 与 -2x 标准差之间，权益资产相较债券而言仍然具备性价比。存款利率下调、债券年内收益低等可能驱动存款及理财搬家，逐步流入股市。近期两融余额开始走升，市场赚钱效应提升，指数近期表现较为积极，对居民配置行为可能形成正反馈。当前转债的估值并不低，使得整体容错率明显下降。从市场绝对定价来看，考虑到剩余期限继续压缩，转债整体依托自身估值抬升的赚钱效应有限，主要依托于正股走势。在配置资金驱动、转债市场缩容的背景下，转债市场下半年可能维持结构性估值偏高状态，但对于偏债型目前相对极端的估值位置，未来预计还是会有一个从极端位置回归的过程。偏股型、平衡型性价比相对更高。历史规律来看，市场震荡向上区间，小市值低评级转债往往可能明显跑赢大市值高评级转债，当前看小盘风格占优的行情预计有望延续。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。为确保基金估值工作符合以上规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、法律合规部负责人、风险管理部负责人、投资部门负责人、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具备良好专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价，保证基金估值的公平、合理。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当对估值原则及技术存有异议时，本基金托管人有责任要求本基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.6.1	686,128,629.51	253,703,240.90
结算备付金		44,251,368.38	104,011,115.88

存出保证金		1, 598, 213. 95	1, 229, 394. 44
交易性金融资产	6.4.6.2	36, 365, 230, 029. 99	38, 036, 843, 597. 25
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		36, 365, 230, 029. 99	38, 036, 843, 597. 25
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.6.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.6.4	332, 000, 000. 00	474, 953, 408. 76
其他债权投资		—	—
其他权益工具投资		—	—
应收清算款		42, 156. 28	59, 235. 14
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.6.5	75, 616. 24	—
资产总计		37, 429, 326, 014. 35	38, 870, 799, 992. 37
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
负债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.6.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		497, 077, 827. 77	342, 544, 560. 84
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		4, 244, 849. 15	4, 456, 669. 74
应付托管费		1, 414, 949. 73	1, 485, 556. 59
应付销售服务费		—	—
应付投资顾问费		—	—
应交税费		664, 008. 50	655, 137. 90
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.6.6	1, 927, 137. 19	3, 457, 879. 70
负债合计		505, 328, 772. 34	352, 599, 804. 77
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	29, 771, 868, 433. 70	33, 208, 868, 623. 72
其他综合收益		—	—
未分配利润	6.4.6.8	7, 152, 128, 808. 31	5, 309, 331, 563. 88
净资产合计		36, 923, 997, 242. 01	38, 518, 200, 187. 60
负债和净资产总计		37, 429, 326, 014. 35	38, 870, 799, 992. 37

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 12.4023 元，基金份额总额 2,977,186,670.00 份。

6.2 利润表

会计主体：博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至2025 年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30 日
一、营业收入		2,560,627,698.68	45,547,981.57
1. 利息收入		4,386,402.57	1,369,189.20
其中：存款利息收入	6.4.6.9	567,875.57	374,363.19
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		3,818,527.00	994,826.01
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,348,589,807.10	46,414,544.21
其中：股票投资收益	6.4.6.10	-8,028,175.61	1,564,378.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.11	1,356,617,982.71	44,850,165.77
资产支持证券投资收益	6.4.6.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.13	-	-
股利收益	6.4.6.14	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.15	1,181,497,863.60	-14,502,836.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	26,153,625.41	12,267,084.73
减：二、营业总支出		39,366,161.47	8,996,253.47
1. 管理人报酬		27,725,349.84	5,939,681.33
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		9,241,783.29	1,979,893.76
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	6.4.6.17	-	-
7. 税金及附加		465,753.85	74,272.54
8. 其他费用	6.4.6.18	1,933,274.49	1,002,405.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,521,261,537.21	36,551,728.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,521,261,537.21	36,551,728.10

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,521,261,537.21	36,551,728.10

6.3 净资产变动表

会计主体：博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025年1月1日至2025年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	33,208,868,623.72	-	5,309,331,563.88	38,518,200,187.60
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	33,208,868,623.72	-	5,309,331,563.88	38,518,200,187.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,437,000,190.02	-	1,842,797,244.43	-1,594,202,945.59
(一)、综合收益总额	-	-	2,521,261,537.21	2,521,261,537.21
(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）	-3,437,000,190.02	-	-678,464,292.78	-4,115,464,482.80
其中：1. 基金申购款	5,492,000,321.99	-	1,090,133,059.07	6,582,133,381.06
2. 基金赎回款	-8,929,000,512.01	-	-1,768,597,351.85	-10,697,597,863.86
(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	29,771,868,433.70	-	7,152,128,808.31	36,923,997,242.01
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,734,867,031.27	-	549,380,924.19	6,284,247,955.46

产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	5,734,867,031.27	-	549,380,924.19	6,284,247,955.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,197,000,301.83	-	536,712,606.13	5,733,712,907.96
(一)、综合收益总额	-	-	36,551,728.10	36,551,728.10
(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）	5,197,000,301.83	-	500,160,878.03	5,697,161,179.86
其中：1. 基金申购款	5,859,000,340.17	-	561,438,960.72	6,420,439,300.89
2. 基金赎回款	-662,000,038.34	-	-61,278,082.69	-723,278,121.03
(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	10,931,867,333.10	-	1,086,093,530.32	12,017,960,863.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：王德英，会计机构负责人：陈子成

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博时中证可转债及可交换债券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[2019]2354 号《关于准予博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，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 601,864,335.00 元（含所募集债券市值），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（2020）第 0146 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 3 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额

总额为 601,866,735.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,400.00 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）自律监管决定书[2020]86 号核准，本基金于 2020 年 4 月 7 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金管理法》和《博时中证可转债及可交换债券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债券和备选成份债券。本基金不直接从二级市场买入股票，也不参与一级市场新股或增发新股的申购。但可持有因可转债转股所形成的股票、因可交换债换股所形成的股票，不过须在其可交易之日起 10 个交易日内卖出。本基金投资于标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的 80%，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，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。本基金的业绩比较基准为：中证可转债及可交换债券指数收益率。

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”）、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》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。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
活期存款	686,128,629.51
等于：本金	686,047,253.33
加：应计利息	81,376.18
减：坏账准备	-

定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	686,128,629.51

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	—	—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	33,593,746,157.53	235,969,009.85	36,365,230,029.99
	银行间市场	—	—	—
	合计	33,593,746,157.53	235,969,009.85	36,365,230,029.99
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	33,593,746,157.53	235,969,009.85	36,365,230,029.99	2,535,514,862.61

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

6.4.6.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	332,000,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	332,000,000.00	—

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.6.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末
	2025年6月30日
应收利息	—
其他应收款	—
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

6.4.6.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
	2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	85,829.99
其中：交易所市场	85,829.99
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	104,138.35
应付指数使用费	1,727,251.86
应付 IOPV 计算与发布费	9,916.99
合计	1,927,137.19

6.4.6.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,320,886,670.00	33,208,868,623.72
本期申购	549,200,000.00	5,492,000,321.99
本期赎回(以“-”号填列)	-892,900,000.00	-8,929,000,512.01
本期末	2,977,186,670.00	29,771,868,433.70

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额(如适用)。

6.4.6.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,618,609,973.98	-309,278,410.10	5,309,331,563.88
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	5,618,609,973.98	-309,278,410.10	5,309,331,563.88
本期利润	1,339,763,673.61	1,181,497,863.60	2,521,261,537.21
本期基金份额交易产生的变动数	-630,313,617.92	-48,150,674.86	-678,464,292.78
其中：基金申购款	1,053,796,192.47	36,336,866.60	1,090,133,059.07
基金赎回款	-1,684,109,810.39	-84,487,541.46	-1,768,597,351.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,328,060,029.67	824,068,778.64	7,152,128,808.31

6.4.6.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	455,595.00
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	109,273.62
其他	3,006.95
合计	567,875.57

6.4.6.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	2,057,524,482.26
减：卖出股票成本总额	2,063,968,309.93
减：交易费用	1,584,347.94
买卖股票差价收入	-8,028,175.61

6.4.6.11 债券投资收益

6.4.6.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	225,551,507.67
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,131,066,475.04
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	1,356,617,982.71

6.4.6.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	16,647,354,232.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,418,001,218.26
减：应计利息总额	97,218,757.40
减：交易费用	1,067,781.34
买卖债券差价收入	1,131,066,475.04

6.4.6.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	10,697,597,863.86
减：现金支付赎回款总额	10,697,597,863.86
减：赎回债券成本总额	—
减：赎回债券应计利息总额	—
减：交易费用	—
赎回差价收入	—

6.4.6.12 资产支持证券投资收益

6.4.6.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.6.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.6.13 衍生工具收益

6.4.6.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.6.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

6.4.6.14 股利收益

无发生额。

6.4.6.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	1,181,497,863.60
——股票投资	—
——债券投资	1,181,497,863.60
——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	1,181,497,863.60

6.4.6.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
基金赎回费收入		—
替代损益		26,153,625.41
合计		26,153,625.41

6.4.6.17 信用减值损失

无发生额。

6.4.6.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
审计费用		44,630.98
信息披露费		59,507.37
证券出借违约金		—
银行汇划费		17,583.53
中登注册登记费		74,383.76
指数使用费		1,727,251.86
IOPV 计算与发布费		9,916.99
合计		1,933,274.49

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》(财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号)，规定自 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。

6.4.8 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

无。

6.4.9.1.2 权证交易

无。

6.4.9.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总 额的比例
招商证券	5,943,242,633.30	22.00%	-	-

6.4.9.1.4 债券回购交易

无。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	27,725,349.84	5,939,681.33
其中：应支付销售机构的客户维护费	104,327.75	268.97
应支付基金管理人的净管理费	27,621,022.09	5,939,412.36

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 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,241,783.29	1,979,893.76

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}.$$

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.9.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.9.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.9.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.9.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日		份额单位：份
	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	
招商证券	399,992.00	0.01%	288,750.00	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. 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。

6.4.9.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	686,128,629.51	455,595.00	219,312,934.08	265,009.66

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

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10 利润分配情况

无。

6.4.11 期末（2025年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于债券型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金采用优化抽样复制策略，跟踪中证可转债及可交换债券指数，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的最小化。

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与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管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、

检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.12.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放本基金的托管人，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，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年末 2024年12月31日
AAA	13,692,252,721.72	16,265,037,786.22
AAA 以下	22,672,977,555.98	21,771,806,980.75
未评级	-	-
合计	36,365,230,277.70	38,036,844,766.97

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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。

6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金管理规定》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。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 5年 6月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资 产					
货币	686,128,629.51	-	-	-	686,128,629.51

资金					
结算备付金	44,251,368.38	-	-	-	44,251,368.38
存出保证金	1,598,213.95	-	-	-	1,598,213.95
交易性金融资产	4,466,613,711.40	29,459,119,390.78	2,439,496,927.81	-	36,365,230,029.99
应收清算款	-	-	-	42,156.28	42,156.28
买入返售金融资产	332,000,000.00	-	-	-	332,000,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	5,530,591,923.24	29,459,119,390.78	2,439,496,927.81	117,772.52	37,429,326,014.35
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	497,077,827.77	497,077,827.77
应付管理人报酬	-	-	-	4,244,849.15	4,244,849.15
应付托管费	-	-	-	1,414,949.73	1,414,949.73
应付销售	-	-	-	-	-

服务费					
应交税费	-	-	-	664,008.50	664,008.50
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,927,137.19	1,927,137.19
负债总计	-	-	-	505,328,772.34	505,328,772.34
利率敏感度缺口	5,530,591,923.24	29,459,119,390.78	2,439,496,927.81	-505,210,999.82	36,923,997,242.01
上年度末 2024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	253,703,240.90	-	-	-	253,703,240.90
结算备付金	104,011,115.88	-	-	-	104,011,115.88
存出保证金	1,229,394.44	-	-	-	1,229,394.44
交易性金融资产	5,521,653,745.22	30,735,252,023.67	1,779,937,828.36	-	38,036,843,597.25
应收清算款	-	-	-	59,235.14	59,235.14
买入返售金融资产	474,953,408.76	-	-	-	474,953,408.76
应收	-	-	-	-	-

申购款					
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,355,550,905. 20	30,735,252,023. 67	1,779,937,828. 36	59,235.14	38,870,799,992. 37
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	342,544,560.84	342,544,560.84
应付管理人报酬	-	-	-	4,456,669.74	4,456,669.74
应付托管费	-	-	-	1,485,556.59	1,485,556.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	655,137.90	655,137.90
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,457,879.70	3,457,879.70
负债总计	-	-	-	352,599,804.77	352,599,804.77
利率敏感度	6,355,550,905. 20	30,735,252,023. 67	1,779,937,828. 36	-352,540,569. 63	38,518,200,187. 60

缺 口				
--------	--	--	--	--

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。

6.4.12.4.1.2 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(不包括可转债和可交换债)、资产支持证券投资和国债期货投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期：同）。

6.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	36,365,230,029.99	98.49	38,036,843,597.25	98.75
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	36,365,230,029.99	98.49	38,036,843,597.25	98.75

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，期货投资于相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为0。

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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）	
分析		本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
业绩比较基准上升 5%	增加约 178,849	增加约 193,113	
	业绩比较基准下降 5%	减少约 178,849	减少约 193,113

6.4.13 公允价值

6.4.13.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.13.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年6月30日
第一层次	36,361,602,580.25
第二层次	3,627,449.74
第三层次	-
合计	36,365,230,029.99

6.4.13.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.13.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.13.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-

	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	36,365,230,029.99	97.16
	其中：债券	36,365,230,029.99	97.16
	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	332,000,000.00	0.89
	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	730,379,997.89	1.95
8	其他各项资产	1,715,986.47	0.00
9	合计	37,429,326,014.35	100.00

注：债券投资项包含可退替代款估值增值。

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

本基金本报告期末未持有境内股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	601006	大秦铁路	519,530,632.86	1.35
2	601998	中信银行	222,527,139.84	0.58
3	601689	拓普集团	148,641,430.32	0.39
4	002966	苏州银行	131,368,181.18	0.34
5	002335	科华数据	126,627,635.56	0.33
6	600926	杭州银行	113,898,898.05	0.30
7	000034	神州数码	88,550,028.31	0.23
8	300409	道氏技术	64,499,282.48	0.17
9	300953	震裕科技	59,755,605.38	0.16
10	002895	川恒股份	56,819,278.95	0.15
11	300871	回盛生物	35,226,369.78	0.09
12	300918	南山智尚	32,187,849.20	0.08
13	300814	中富电路	29,704,875.99	0.08

14	603678	火炬电子	27,885,707.49	0.07
15	002975	博杰股份	26,309,828.19	0.07
16	300829	金丹科技	26,176,137.43	0.07
17	300872	天阳科技	25,699,119.66	0.07
18	000065	北方国际	24,210,575.95	0.06
19	603956	威派格	23,093,408.69	0.06
20	300543	朗科智能	22,565,258.28	0.06

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交量）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	601006	大秦铁路	514,422,657.33	1.34
2	601998	中信银行	223,042,562.01	0.58
3	601689	拓普集团	149,390,175.13	0.39
4	002335	科华数据	145,864,792.51	0.38
5	002966	苏州银行	131,023,916.84	0.34
6	600926	杭州银行	114,551,628.38	0.30
7	000034	神州数码	91,065,650.85	0.24
8	300409	道氏技术	63,818,312.90	0.17
9	002895	川恒股份	57,192,165.76	0.15
10	300953	震裕科技	44,748,463.18	0.12
11	300871	回盛生物	34,378,215.52	0.09
12	300918	南山智尚	31,519,204.62	0.08
13	300814	中富电路	30,217,649.61	0.08
14	002975	博杰股份	26,303,215.50	0.07
15	300872	天阳科技	25,817,092.20	0.07
16	603678	火炬电子	25,398,440.55	0.07
17	000065	北方国际	24,530,321.10	0.06
18	300829	金丹科技	24,098,593.73	0.06
19	603956	威派格	22,929,798.49	0.06
20	301099	雅创电子	22,036,850.77	0.06

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交量）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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,063,968,309.93
卖出股票的收入（成交）总额	2,057,524,482.26

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	-	-
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）	36,365,230,029.99		98.49
8	同业存单		-	-
9	其他		-	-
10	合计	36,365,230,029.99		98.49

注：上述可转债（可交换债）投资项包含可退替代款估值增值。

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	113052	兴业转债	22,080,230	2,748,864,622.71	7.44
2	110059	浦发转债	22,039,140	2,484,822,463.17	6.73
3	113042	上银转债	8,830,980	1,127,676,225.11	3.05
4	113056	重银转债	5,740,970	723,108,201.71	1.96
5	132026	G三峡EB2	4,401,030	636,557,141.76	1.72

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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河南省分行、中国人民银行浙江省分行、国家外汇管理局黑龙江省分局、安阳金融监管分局、青海银保监局的处罚。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、国家金融监督管理总局深圳监管局、深圳市市场监督管理局的处罚。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常德市分行、国家外汇管理局广西壮族自治区分局、国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。重庆银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局毕节监管分局、国家金融监督管理总局涪陵监管分局的处罚。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。

7.12.2 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	1,598,213.95
2	应收清算款	42,156.28
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	75,616.24
8	其他	—
9	合计	1,715,986.47

7.12.3 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

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113052	兴业转债	2,748,864,622.71	7.44
2	110059	浦发转债	2,484,822,463.17	6.73
3	113042	上银转债	1,127,676,225.11	3.05
4	113056	重银转债	723,108,201.71	1.96
5	132026	G三峡EB2	636,557,141.76	1.72
6	110085	通22转债	597,200,346.15	1.62
7	127045	牧原转债	510,898,332.12	1.38
8	118034	晶能转债	458,039,572.90	1.24
9	110081	闻泰转债	424,169,248.74	1.15
10	113641	华友转债	421,688,329.40	1.14
11	123107	温氏转债	419,814,111.64	1.14
12	127089	晶澳转债	414,967,461.23	1.12
13	118031	天23转债	410,641,199.56	1.11
14	110073	国投转债	410,362,393.93	1.11

15	127049	希望转 2	407,051,406.81	1.10
16	113065	齐鲁转债	378,216,904.16	1.02
17	113053	隆 22 转债	370,958,308.77	1.00
18	113062	常银转债	340,857,550.05	0.92
19	110075	南航转债	325,522,385.34	0.88
20	127018	本钢转债	297,325,451.09	0.81
21	128129	青农转债	257,681,245.70	0.70
22	127083	山路转债	242,485,848.55	0.66
23	127056	中特转债	240,620,947.30	0.65
24	127030	盛虹转债	239,956,392.87	0.65
25	113037	紫银转债	227,320,420.13	0.62
26	113691	和邦转债	219,994,677.84	0.60
27	113043	财通转债	208,548,743.80	0.56
28	127040	国泰转债	207,756,641.40	0.56
29	113059	福莱转债	198,354,472.09	0.54
30	113045	环旭转债	179,242,647.44	0.49
31	127086	恒邦转债	177,265,609.42	0.48
32	111010	立昂转债	172,869,574.37	0.47
33	127073	天赐转债	172,792,984.49	0.47
34	113049	长汽转债	171,645,725.56	0.46
35	110093	神马转债	163,798,789.07	0.44
36	127020	中金转债	163,266,603.45	0.44
37	127084	柳工转 2	162,760,315.14	0.44
38	113661	福 22 转债	161,773,413.46	0.44
39	113067	燃 23 转债	159,121,820.08	0.43
40	113051	节能转债	159,081,826.01	0.43
41	110062	烽火转债	157,506,796.47	0.43
42	118024	冠宇转债	157,297,680.81	0.43
43	118022	锂科转债	154,289,316.31	0.42
44	110067	华安转债	154,224,837.55	0.42
45	128136	立讯转债	153,522,253.57	0.42
46	123247	万凯转债	147,229,046.87	0.40
47	110089	兴发转债	143,710,885.62	0.39
48	110087	天业转债	142,478,716.83	0.39
49	127067	恒逸转 2	142,158,645.64	0.39
50	113685	升 24 转债	140,174,740.22	0.38
51	128081	海亮转债	139,029,976.67	0.38
52	113616	韦尔转债	132,335,727.65	0.36
53	113623	凤 21 转债	129,405,561.21	0.35
54	127061	美锦转债	127,552,490.06	0.35
55	123118	惠城转债	124,784,634.97	0.34
56	127107	领益转债	123,645,236.86	0.33
57	113054	绿动转债	123,445,720.55	0.33
58	110095	双良转债	119,549,059.23	0.32
59	127085	韵达转债	119,262,370.75	0.32
60	118030	睿创转债	117,301,144.24	0.32
61	127050	麒麟转债	113,863,247.69	0.31
62	113632	鹤 21 转债	112,886,591.47	0.31
63	113058	友发转债	112,076,725.36	0.30
64	110082	宏发转债	111,615,910.07	0.30

65	113048	晶科转债	111, 389, 308. 62	0. 30
66	113666	爱玛转债	109, 298, 044. 11	0. 30
67	123216	科顺转债	108, 490, 004. 54	0. 29
68	123119	康泰转 2	108, 383, 154. 37	0. 29
69	123158	宙邦转债	106, 059, 184. 30	0. 29
70	113655	欧 22 转债	102, 672, 221. 93	0. 28
71	127027	能化转债	99, 066, 247. 49	0. 27
72	110086	精工转债	97, 888, 737. 41	0. 27
73	110063	鹰 19 转债	96, 134, 290. 42	0. 26
74	113682	益丰转债	94, 955, 776. 13	0. 26
75	110076	华海转债	94, 868, 025. 82	0. 26
76	127022	恒逸转债	93, 616, 742. 59	0. 25
77	127103	东南转债	93, 497, 920. 89	0. 25
78	118023	广大转债	92, 846, 699. 02	0. 25
79	113615	金诚转债	91, 838, 586. 25	0. 25
80	127039	北港转债	91, 704, 994. 57	0. 25
81	123161	强联转债	91, 014, 012. 64	0. 25
82	113669	景 23 转债	88, 182, 118. 60	0. 24
83	110090	爱迪转债	85, 859, 737. 72	0. 23
84	113069	博 23 转债	85, 131, 248. 54	0. 23
85	127025	冀东转债	84, 040, 214. 30	0. 23
86	127066	科利转债	82, 042, 349. 88	0. 22
87	113047	旗滨转债	81, 083, 019. 18	0. 22
88	123149	通裕转债	80, 991, 662. 50	0. 22
89	118013	道通转债	80, 983, 467. 99	0. 22
90	113066	平煤转债	80, 519, 008. 84	0. 22
91	127024	盈峰转债	79, 973, 176. 32	0. 22
92	127038	国微转债	79, 939, 123. 92	0. 22
93	127070	大中转债	79, 345, 126. 71	0. 21
94	113068	金铜转债	79, 245, 914. 59	0. 21
95	128131	崇达转 2	78, 739, 514. 13	0. 21
96	128134	鸿路转债	78, 642, 330. 09	0. 21
97	123108	乐普转 2	78, 517, 450. 08	0. 21
98	113692	保隆转债	78, 385, 298. 63	0. 21
99	118025	奕瑞转债	76, 882, 134. 66	0. 21
100	113652	伟 22 转债	76, 047, 958. 11	0. 21
101	127076	中宠转 2	75, 350, 075. 61	0. 20
102	113605	大参转债	75, 349, 958. 16	0. 20
103	113046	金田转债	74, 690, 917. 98	0. 20
104	113064	东材转债	74, 547, 293. 17	0. 20
105	118049	汇成转债	74, 096, 336. 13	0. 20
106	113647	禾丰转债	73, 917, 346. 44	0. 20
107	123176	精测转 2	72, 334, 899. 18	0. 20
108	111018	华康转债	71, 679, 298. 41	0. 19
109	123128	首华转债	70, 026, 722. 86	0. 19
110	123210	信服转债	69, 991, 328. 55	0. 19
111	113677	华懋转债	69, 808, 583. 73	0. 19
112	128135	洽洽转债	68, 872, 564. 69	0. 19
113	127016	鲁泰转债	68, 649, 546. 22	0. 19
114	123169	正海转债	68, 339, 934. 86	0. 19

115	123145	药石转债	67,892,939.10	0.18
116	123178	花园转债	67,552,962.38	0.18
117	128141	旺能转债	67,162,730.65	0.18
118	128144	利民转债	67,110,156.23	0.18
119	110092	三房转债	67,082,999.73	0.18
120	128108	蓝帆转债	66,329,372.11	0.18
121	110094	众和转债	65,656,369.53	0.18
122	127101	豪鹏转债	65,080,203.68	0.18
123	127082	亚科转债	64,634,075.82	0.18
124	113675	新23转债	64,100,164.38	0.17
125	110064	建工转债	63,855,480.57	0.17
126	113033	利群转债	63,685,067.76	0.17
127	110097	天润转债	63,658,224.74	0.17
128	113659	莱克转债	62,420,798.91	0.17
129	127052	西子转债	61,434,586.75	0.17
130	127037	银轮转债	61,314,914.02	0.17
131	123249	英搏转债	60,992,489.98	0.17
132	127064	杭氧转债	60,695,525.40	0.16
133	123150	九强转债	59,862,760.57	0.16
134	113690	豪24转债	59,793,374.66	0.16
135	127046	百润转债	59,339,436.89	0.16
136	110077	洪城转债	57,430,908.32	0.16
137	123241	欧通转债	57,394,222.66	0.16
138	118042	奥维转债	57,242,825.10	0.16
139	123213	天源转债	56,879,795.99	0.15
140	118038	金宏转债	54,163,236.74	0.15
141	113640	苏利转债	53,283,591.68	0.14
142	113633	科沃转债	53,007,999.70	0.14
143	123240	楚天转债	52,875,300.80	0.14
144	123104	卫宁转债	52,046,466.13	0.14
145	123113	仙乐转债	51,937,684.08	0.14
146	127031	洋丰转债	51,809,193.12	0.14
147	128109	楚江转债	51,556,886.71	0.14
148	113644	艾迪转债	51,490,246.74	0.14
149	111000	起帆转债	51,110,298.97	0.14
150	113636	甬金转债	51,097,062.36	0.14
151	127102	浙建转债	50,907,713.01	0.14
152	127075	百川转2	49,989,255.25	0.14
153	118000	嘉元转债	49,844,629.89	0.13
154	123117	健帆转债	49,458,164.93	0.13
155	118051	皓元转债	49,421,737.31	0.13
156	127017	万青转债	48,970,283.46	0.13
157	123212	立中转债	48,166,365.68	0.13
158	123114	三角转债	48,160,261.07	0.13
159	110084	贵燃转债	47,957,942.91	0.13
160	123179	立高转债	47,885,517.76	0.13
161	128127	文科转债	47,756,475.38	0.13
162	113631	皖天转债	47,580,431.63	0.13
163	128132	交建转债	46,870,603.84	0.13
164	113673	岱美转债	46,869,026.31	0.13

165	123215	铭利转债	46,652,126.90	0.13
166	113658	密卫转债	46,640,802.62	0.13
167	113648	巨星转债	46,350,716.31	0.13
168	123120	隆华转债	46,343,759.61	0.13
169	128119	龙大转债	46,267,632.53	0.13
170	113545	金能转债	45,892,163.08	0.12
171	111007	永和转债	45,762,294.55	0.12
172	123235	亿田转债	45,727,018.21	0.12
173	111019	宏柏转债	45,645,969.83	0.12
174	123146	中环转 2	45,477,335.87	0.12
175	118050	航宇转债	45,324,754.51	0.12
176	127015	希望转债	45,010,452.11	0.12
177	118027	宏图转债	44,871,555.77	0.12
178	123049	维尔转债	44,367,749.03	0.12
179	123194	百洋转债	44,327,152.38	0.12
180	128133	奇正转债	44,268,085.43	0.12
181	123121	帝尔转债	44,099,598.04	0.12
182	113656	嘉诚转债	44,090,810.59	0.12
183	110096	豫光转债	44,005,285.71	0.12
184	113688	国检转债	43,659,721.84	0.12
185	113679	芯能转债	43,369,297.64	0.12
186	127092	运机转债	43,282,352.22	0.12
187	123165	回天转债	42,849,202.99	0.12
188	127081	中旗转债	42,686,558.99	0.12
189	123251	华医转债	42,547,047.15	0.12
190	127104	姚记转债	42,354,929.75	0.11
191	111021	奥锐转债	42,263,581.59	0.11
192	113634	珀莱转债	42,200,556.83	0.11
193	123188	水羊转债	42,112,572.86	0.11
194	118005	天奈转债	42,017,244.46	0.11
195	127105	龙星转债	41,704,025.29	0.11
196	128130	景兴转债	41,494,440.09	0.11
197	123172	漱玉转债	41,342,405.14	0.11
198	128142	新乳转债	41,270,407.93	0.11
199	127095	广泰转债	40,874,723.14	0.11
200	127019	国城转债	40,575,005.04	0.11
201	123236	家联转债	40,437,265.76	0.11
202	127053	豪美转债	40,429,157.40	0.11
203	113650	博 22 转债	40,295,591.00	0.11
204	118028	会通转债	40,294,481.35	0.11
205	118003	华兴转债	40,155,060.09	0.11
206	123182	广联转债	39,764,938.69	0.11
207	123133	佩蒂转债	39,729,014.01	0.11
208	127068	顺博转债	39,694,193.84	0.11
209	113653	永 22 转债	39,635,186.91	0.11
210	113627	太平转债	39,193,312.66	0.11
211	111017	蓝天转债	38,935,911.83	0.11
212	113687	振华转债	38,422,790.76	0.10
213	123192	科思转债	38,398,949.34	0.10
214	113670	金 23 转债	38,380,682.12	0.10

215	113563	柳药转债	38, 333, 804. 61	0. 10
216	127026	超声转债	38, 152, 976. 87	0. 10
217	127042	嘉美转债	38, 115, 341. 79	0. 10
218	128074	游族转债	37, 740, 960. 87	0. 10
219	123063	大禹转债	37, 501, 735. 80	0. 10
220	113609	永安转债	36, 948, 316. 80	0. 10
221	118008	海优转债	36, 883, 029. 23	0. 10
222	123071	天能转债	36, 464, 536. 84	0. 10
223	127035	濮耐转债	36, 384, 483. 54	0. 10
224	118041	星球转债	35, 865, 879. 18	0. 10
225	113681	镇洋转债	35, 851, 361. 08	0. 10
226	113654	永 02 转债	35, 653, 135. 43	0. 10
227	123131	奥飞转债	35, 510, 559. 90	0. 10
228	111004	明新转债	35, 493, 729. 65	0. 10
229	128116	瑞达转债	35, 261, 777. 01	0. 10
230	123221	力诺转债	35, 192, 700. 83	0. 10
231	113606	荣泰转债	35, 177, 774. 37	0. 10
232	123183	海顺转债	35, 141, 701. 35	0. 10
233	123151	康医转债	34, 882, 344. 66	0. 09
234	118032	建龙转债	34, 815, 759. 46	0. 09
235	111002	特纸转债	34, 574, 842. 01	0. 09
236	113667	春 23 转债	34, 567, 294. 36	0. 09
237	128128	齐翔转 2	34, 514, 478. 46	0. 09
238	111009	盛泰转债	34, 501, 429. 96	0. 09
239	123233	凯盛转债	34, 301, 818. 90	0. 09
240	123174	精锻转债	34, 272, 950. 70	0. 09
241	123225	翔丰转债	34, 270, 685. 05	0. 09
242	123076	强力转债	34, 246, 152. 97	0. 09
243	118004	博瑞转债	34, 233, 530. 20	0. 09
244	111015	东亚转债	34, 039, 455. 43	0. 09
245	113629	泉峰转债	34, 006, 945. 61	0. 09
246	127078	优彩转债	33, 976, 251. 50	0. 09
247	128105	长集转债	33, 744, 368. 38	0. 09
248	118033	华特转债	33, 582, 625. 57	0. 09
249	123217	富仕转债	33, 142, 091. 26	0. 09
250	111011	冠盛转债	32, 945, 794. 00	0. 09
251	118048	利扬转债	32, 944, 664. 91	0. 09
252	113584	家悦转债	32, 727, 014. 56	0. 09
253	127041	弘亚转债	32, 713, 568. 78	0. 09
254	123193	海能转债	32, 620, 679. 04	0. 09
255	128137	洁美转债	32, 510, 197. 28	0. 09
256	111016	神通转债	32, 444, 199. 59	0. 09
257	110074	精达转债	32, 227, 555. 44	0. 09
258	128121	宏川转债	32, 063, 924. 14	0. 09
259	123085	万顺转 2	31, 951, 367. 33	0. 09
260	113676	荣 23 转债	31, 602, 425. 05	0. 09
261	123064	万孚转债	31, 588, 247. 44	0. 09
262	111014	李子转债	31, 434, 534. 52	0. 09
263	111001	山玻转债	31, 392, 207. 14	0. 09
264	127060	湘佳转债	31, 357, 227. 77	0. 08

265	113621	彤程转债	31, 339, 513. 34	0. 08
266	123082	北陆转债	31, 026, 726. 97	0. 08
267	113638	台 21 转债	30, 931, 591. 32	0. 08
268	113663	新化转债	30, 874, 520. 90	0. 08
269	127088	赫达转债	30, 863, 822. 03	0. 08
270	113625	江山转债	30, 786, 307. 23	0. 08
271	113678	中贝转债	30, 717, 479. 27	0. 08
272	123195	蓝晓转 02	30, 536, 985. 60	0. 08
273	118020	芳源转债	30, 507, 653. 92	0. 08
274	123162	东杰转债	30, 206, 903. 48	0. 08
275	113639	华正转债	30, 203, 007. 76	0. 08
276	123122	富瀚转债	30, 086, 382. 21	0. 08
277	123144	裕兴转债	29, 663, 579. 92	0. 08
278	111005	富春转债	29, 636, 696. 10	0. 08
279	113542	好客转债	29, 467, 081. 37	0. 08
280	123239	锋工转债	29, 085, 454. 40	0. 08
281	123147	中辰转债	29, 081, 938. 15	0. 08
282	118043	福立转债	29, 077, 261. 20	0. 08
283	123091	长海转债	28, 942, 627. 93	0. 08
284	123056	雪榕转债	28, 828, 593. 28	0. 08
285	113657	再 22 转债	28, 786, 224. 67	0. 08
286	127071	天箭转债	28, 583, 840. 69	0. 08
287	123237	佳禾转债	28, 432, 746. 32	0. 08
288	123142	申昊转债	28, 430, 710. 04	0. 08
289	118012	微芯转债	28, 195, 037. 93	0. 08
290	127054	双箭转债	28, 031, 113. 83	0. 08
291	118035	国力转债	27, 892, 165. 08	0. 08
292	127069	小熊转债	27, 890, 795. 38	0. 08
293	123243	严牌转债	27, 826, 712. 25	0. 08
294	113643	风语转债	27, 603, 296. 59	0. 07
295	123124	晶瑞转 2	27, 558, 699. 65	0. 07
296	123186	志特转债	27, 439, 610. 44	0. 07
297	118014	高测转债	27, 282, 798. 81	0. 07
298	127072	博实转债	27, 240, 138. 07	0. 07
299	127077	华宏转债	27, 195, 106. 42	0. 07
300	123154	火星转债	27, 111, 914. 84	0. 07
301	113649	丰山转债	26, 979, 543. 86	0. 07
302	113664	大元转债	26, 744, 784. 59	0. 07
303	113618	美诺转债	26, 571, 347. 24	0. 07
304	118011	银微转债	26, 534, 577. 41	0. 07
305	127099	盛航转债	26, 338, 619. 94	0. 07
306	123090	三诺转债	26, 267, 823. 51	0. 07
307	123168	惠云转债	26, 263, 379. 61	0. 07
308	118037	上声转债	26, 200, 863. 78	0. 07
309	118044	赛特转债	25, 965, 346. 05	0. 07
310	127055	精装转债	25, 626, 191. 02	0. 07
311	123244	松原转债	25, 289, 810. 47	0. 07
312	113579	健友转债	25, 004, 981. 49	0. 07
313	128138	侨银转债	24, 856, 044. 90	0. 07
314	127090	兴瑞转债	24, 847, 835. 13	0. 07

315	123200	海泰转债	24,734,654.00	0.07
316	123156	博汇转债	24,660,700.23	0.07
317	123109	昌红转债	24,636,712.98	0.07
318	123214	东宝转债	24,630,495.06	0.07
319	113689	洛凯转债	24,606,129.02	0.07
320	128095	恩捷转债	24,582,554.32	0.07
321	123211	阳谷转债	24,490,207.02	0.07
322	113672	福蓉转债	24,316,032.39	0.07
323	128125	华阳转债	24,186,823.79	0.07
324	118039	煜邦转债	24,183,938.33	0.07
325	127028	英特转债	24,157,601.19	0.07
326	113628	晨丰转债	24,101,933.08	0.07
327	118029	富森转债	24,063,731.79	0.07
328	127098	欧晶转债	23,777,616.94	0.06
329	127079	华亚转债	23,300,669.00	0.06
330	128097	奥佳转债	23,288,489.49	0.06
331	113674	华设转债	23,005,472.66	0.06
332	127034	绿茵转债	22,853,936.74	0.06
333	118015	芯海转债	22,584,479.23	0.06
334	123234	中能转债	22,538,312.31	0.06
335	118006	阿拉转债	22,471,021.29	0.06
336	118040	宏微转债	22,431,255.62	0.06
337	113593	沪工转债	22,426,469.66	0.06
338	113549	白电转债	22,417,914.08	0.06
339	118009	华锐转债	22,266,279.62	0.06
340	123250	嘉益转债	22,200,276.66	0.06
341	118010	洁特转债	22,171,937.16	0.06
342	123207	冠中转债	21,953,282.37	0.06
343	127062	垒知转债	21,932,611.56	0.06
344	111012	福新转债	21,859,289.14	0.06
345	118036	力合转债	21,844,818.26	0.06
346	123197	光力转债	21,775,341.45	0.06
347	113624	正川转债	21,619,273.30	0.06
348	118018	瑞科转债	21,606,386.63	0.06
349	113660	寿22转债	20,849,555.50	0.06
350	127059	永东转2	20,708,975.64	0.06
351	123130	设研转债	20,700,618.71	0.06
352	123175	百畅转债	20,171,199.76	0.05
353	123222	博俊转债	20,142,177.45	0.05
354	123201	纽泰转债	20,077,054.48	0.05
355	123171	共同转债	19,797,618.56	0.05
356	111013	新港转债	18,667,039.64	0.05
357	113686	泰瑞转债	18,478,342.66	0.05
358	113588	润达转债	18,380,777.10	0.05
359	111020	合顺转债	18,237,385.59	0.05
360	123196	正元转02	18,227,040.66	0.05
361	127094	红墙转债	18,204,850.19	0.05
362	123092	天壕转债	18,179,504.86	0.05
363	118021	新致转债	18,074,770.32	0.05
364	123141	宏丰转债	17,956,226.73	0.05

365	123126	瑞丰转债	17, 949, 894. 67	0. 05
366	113665	汇通转债	17, 775, 818. 55	0. 05
367	123155	中陆转债	17, 751, 727. 76	0. 05
368	123230	金钟转债	17, 712, 894. 79	0. 05
369	123187	超达转债	17, 546, 302. 52	0. 05
370	123248	恒辉转债	17, 456, 396. 70	0. 05
371	123220	易瑞转债	17, 454, 319. 31	0. 05
372	123198	金浦转债	17, 390, 184. 61	0. 05
373	123185	能辉转债	17, 361, 478. 84	0. 05
374	123189	晓鸣转债	16, 972, 522. 46	0. 05
375	123199	山河转债	16, 242, 876. 12	0. 04
376	123166	蒙泰转债	16, 171, 302. 21	0. 04
377	113597	佳力转债	16, 153, 970. 22	0. 04
378	128101	联创转债	16, 016, 766. 86	0. 04
379	113039	嘉泽转债	15, 956, 477. 17	0. 04
380	113683	伟 24 转债	15, 861, 189. 80	0. 04
381	127044	蒙娜转债	15, 850, 730. 12	0. 04
382	127096	泰坦转债	15, 844, 144. 59	0. 04
383	123245	集智转债	15, 738, 505. 78	0. 04
384	127106	伟隆转债	15, 696, 318. 10	0. 04
385	123231	信测转债	15, 604, 461. 07	0. 04
386	123088	威唐转债	15, 572, 781. 90	0. 04
387	123246	远信转债	15, 534, 010. 91	0. 04
388	123159	崧盛转债	15, 409, 847. 61	0. 04
389	123180	浙矿转债	15, 232, 350. 52	0. 04
390	113671	武进转债	15, 179, 361. 46	0. 04
391	123224	宇邦转债	15, 025, 138. 80	0. 04
392	110060	天路转债	14, 813, 835. 34	0. 04
393	118016	京源转债	14, 805, 959. 10	0. 04
394	113680	丽岛转债	14, 732, 559. 33	0. 04
395	113668	鹿山转债	14, 684, 319. 62	0. 04
396	113651	松霖转债	14, 646, 762. 28	0. 04
397	123093	金陵转债	14, 617, 448. 34	0. 04
398	113569	科达转债	14, 580, 553. 04	0. 04
399	128071	合兴转债	14, 436, 744. 86	0. 04
400	118007	山石转债	14, 299, 261. 01	0. 04
401	123242	赛龙转债	14, 237, 612. 74	0. 04
402	123157	科蓝转债	14, 213, 953. 48	0. 04
403	123206	开能转债	14, 206, 974. 98	0. 04
404	123160	泰福转债	13, 574, 481. 97	0. 04
405	123089	九洲转 2	13, 490, 730. 86	0. 04
406	123173	恒锋转债	13, 295, 084. 84	0. 04
407	127093	章鼓转债	13, 089, 932. 58	0. 04
408	123048	应急转债	12, 670, 947. 61	0. 03
409	123112	万讯转债	12, 611, 198. 75	0. 03
410	128122	兴森转债	12, 209, 818. 91	0. 03
411	113565	宏辉转债	12, 172, 242. 23	0. 03
412	123138	丝路转债	12, 153, 109. 36	0. 03
413	123129	锦鸡转债	12, 122, 900. 66	0. 03
414	118045	盟升转债	11, 399, 101. 80	0. 03

415	123223	九典转 02	11, 388, 432. 82	0. 03
416	128076	金轮转债	11, 380, 327. 46	0. 03
417	113574	华体转债	11, 374, 982. 41	0. 03
418	123209	聚隆转债	11, 304, 470. 57	0. 03
419	123065	宝莱转债	11, 104, 562. 96	0. 03
420	123232	金现转债	11, 052, 393. 16	0. 03
421	123039	开润转债	10, 994, 897. 99	0. 03
422	111003	聚合转债	10, 985, 898. 28	0. 03
423	113030	东风转债	10, 829, 950. 82	0. 03
424	110070	凌钢转债	10, 361, 894. 99	0. 03
425	123054	思特转债	10, 071, 964. 93	0. 03
426	128124	科华转债	10, 034, 558. 10	0. 03
427	128120	联诚转债	10, 033, 179. 87	0. 03
428	123059	银信转债	9, 836, 196. 08	0. 03
429	123061	航新转债	9, 828, 418. 78	0. 03
430	123087	明电转债	9, 784, 817. 91	0. 03
431	123229	艾录转债	9, 401, 635. 49	0. 03
432	128082	华锋转债	9, 030, 515. 32	0. 02
433	123203	明电转 02	8, 740, 995. 18	0. 02
434	123177	测绘转债	8, 190, 169. 44	0. 02
435	128070	智能转债	3, 627, 449. 74	0. 01

7.12.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	份额单位：份			
		持有人结构		个人投资者	
		机构投资者 持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例
10, 519	283, 029. 44	2, 930, 401, 015. 00	98. 43%	46, 785, 655. 00	1. 57%

8.2 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	国泰金色年华稳定类固定	96, 800, 000. 00	3. 25%

	收益型养老金产品—中国农业银行股份有限公司		
2	广发证券股份有限公司	80,137,689.00	2.69%
3	国泰海通证券股份有限公司	63,808,577.00	2.14%
4	信泰人寿保险股份有限公司—传统产品	55,866,509.00	1.88%
5	基本养老保险基金—零七组合	51,383,900.00	1.73%
6	中国银河证券股份有限公司	51,242,005.00	1.72%
7	新华人寿保险股份有限公司—传统产品	48,422,322.00	1.63%
8	国泰金色年华固定收益型养老金产品—中国建设银行股份有限公司	43,454,272.00	1.46%
9	中邮理财有限责任公司—邮银财富·债券 2018 年第 244 期（每周定开净值型）	42,016,588.00	1.41%
10	中信建投证券股份有限公司	40,995,365.00	1.38%

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。

8.3 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。

8.4 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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 3 月 6 日）基金份额总额	601,866,735.00
本报告期期初基金份额总额	3,320,886,670.00
本报告期基金总申购份额	549,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	892,900,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,977,186,670.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年起改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	2,057,524,482.26	100.00%	423,665.35	100.00%	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-

中信证券	1	-	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-	-

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) 本公司建立公正公平的证券公司服务评价体系，在符合上述标准的证券公司中进行基金的证券交易佣金分配。主要程序：双方签署服务协议；证券公司提供交易和研究服务；公司每季度分别按照被动股票型基金和其他类型基金的服务评价规则，对证券公司进行服务评价，并按照评分排名确定佣金的分配资格和比例额度。

10.7.2 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
银河证券	10,492,743,641.59	38.84%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	10,582,328,968.40	39.17%	49,137,600,000.00	100.00%	-	-
招商证券	5,943,242,633.30	22.00%	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时中证可转债及可交换债券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	2025-06-26
2	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
3	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
4	关于博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金新增西南证券为申购、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	2025-04-23

5	博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 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	2025-04-22
6	关于博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金新增东海证券为申购、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	2025-04-10
7	博时基金管理有限公司关于运用公司固有资金投资旗下公募基金的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
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-20250408	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
9	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
10	博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
11	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增江海证券为申购、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	2025-03-25
12	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250325	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-25
13	博时中证可转债及可交换债券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	2025-03-22
14	博时中证可转债及可交换债券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	2025-03-21
15	博时中证可转债及可交换债券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	2025-03-19
16	博时中证可转债及可交换债券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	2025-03-19
17	关于博时基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-19
18	关于博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金新增国信证券为申购、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	2025-02-17
19	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增华鑫证券为申购、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	2025-02-13
20	关于博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金新增兴业证券为申购、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	2025-02-12
21	博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 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	2025-01-22

22	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增联储证券为申购、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	2025-01-02
----	---------------------------------------	---------------------------	------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会批准博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金设立的文件

2、《博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3、《博时中证可转债及可交换债券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、博时中证可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本

6、报告期内博时中证可转债及可交换债券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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二五年八月二十九日