

交银施罗德可转债债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 1 月 21 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 01 月 20 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 2025 年 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 交银可转债债券 |
| 基金主代码 | 007316 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 7 月 11 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 77,500,665.03 份 |
| 投资目标 | 本基金主要利用可转债品种兼具债券和股票的特性，在合理控制风险、保持适当流动性的基础上，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | 本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，利用经交银施罗德研究团队修正后的投资时钟分析框架，结合定性分析和定量分析的方法，形成对各大类资产的预测和判断，在基金合同约定的范围内确定债券资产、权益类资产和现金类资产的配置比例，并根据市场运行状况以及各类资产预期表现的相对变化，动态调整大类资产的配置比例，有效控制基金资产运作风险，提高基金资产风险调整后收益。 可转换债券（含可交换债券、可分离交易可转债）通过赋予债券投资者某种期权的形式，兼具债性与股性双重属性，比普通债券更加灵活。债性是指投资者可以选择持有可转换债券至到期以获取票面价值和票面利息；股性是指投资者可以在转股期间以约定的转股价格将可转换债券转换成对应的股票。本基金将综合研究该类投资品种的特性，充分挖掘其投资价值，债券价值方面综合考虑票面利率、久期、信用资质、发行主体财务状况、行业特征及公司治理等因素；权益 |

| | | |
|-----------------|--|-----------------|
| | 价值方面通过对可转换债券所对应个股的价值分析，包括估值水平、盈利能力、业绩预期及个体竞争优势等分析。此外，还需结合对含权条款的研究，综合判断内含期权的价值。 | |
| 业绩比较基准 | 中证可转换债券指数收益率*70%+中债综合全价指数收益率*20%+沪深 300 指数收益率*10% | |
| 风险收益特征 | 本基金是一只债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 交银施罗德基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 交银可转债债券 A | 交银可转债债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 007316 | 007317 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 46,074,131.13 份 | 31,426,533.90 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2025 年 10 月 1 日-2025 年 12 月 31 日） | |
|-----------------|---------------------------------------|---------------|
| | 交银可转债债券 A | 交银可转债债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | 5,036,185.95 | 3,143,976.24 |
| 2. 本期利润 | 1,366,769.32 | 852,833.51 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0292 | 0.0276 |
| 4. 期末基金资产净值 | 82,702,143.51 | 54,970,315.58 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.7950 | 1.7492 |

注：1、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，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

2、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。

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

交银可转债债券 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|
|----|--------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|

| | | | | | | |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.72% | 0.69% | 0.93% | 0.47% | 0.79% | 0.22% |
| 过去六个月 | 19.19% | 0.79% | 9.01% | 0.52% | 10.18% | 0.27% |
| 过去一年 | 30.67% | 0.86% | 14.35% | 0.50% | 16.32% | 0.36% |
| 过去三年 | 35.68% | 0.95% | 20.94% | 0.47% | 14.74% | 0.48% |
| 过去五年 | 39.97% | 0.95% | 23.84% | 0.49% | 16.13% | 0.46% |
| 自基金合同 生效起至今 | 79.50% | 0.96% | 43.04% | 0.51% | 36.46% | 0.45% |

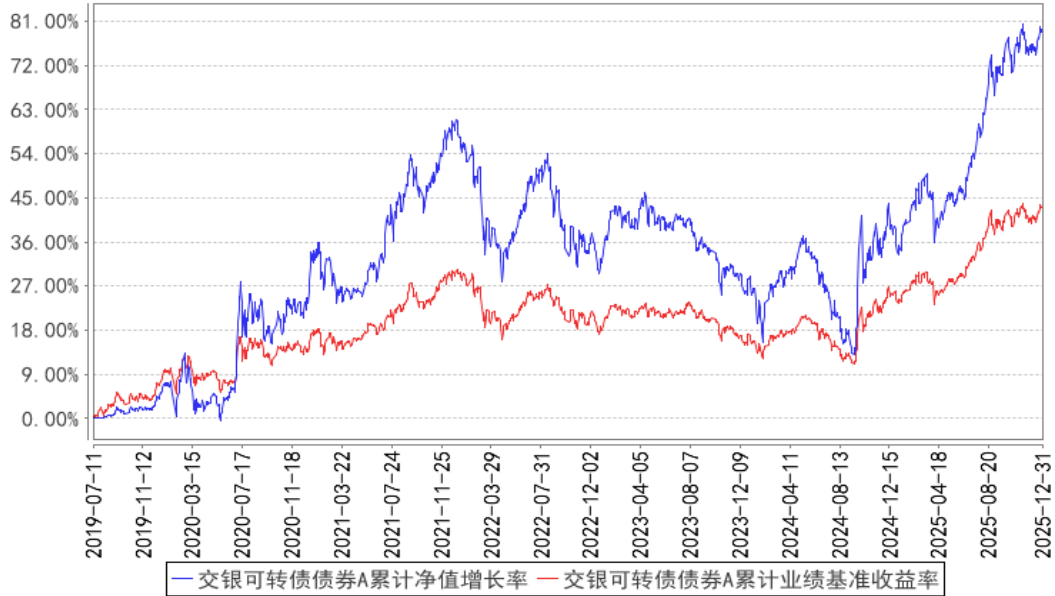
交银可转债债券 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①－③ | ②－④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.62% | 0.69% | 0.93% | 0.47% | 0.69% | 0.22% |
| 过去六个月 | 18.95% | 0.79% | 9.01% | 0.52% | 9.94% | 0.27% |
| 过去一年 | 30.15% | 0.86% | 14.35% | 0.50% | 15.80% | 0.36% |
| 过去三年 | 34.06% | 0.95% | 20.94% | 0.47% | 13.12% | 0.48% |
| 过去五年 | 37.20% | 0.95% | 23.84% | 0.49% | 13.36% | 0.46% |
| 自基金合同 生效起至今 | 74.92% | 0.96% | 43.04% | 0.51% | 31.88% | 0.45% |

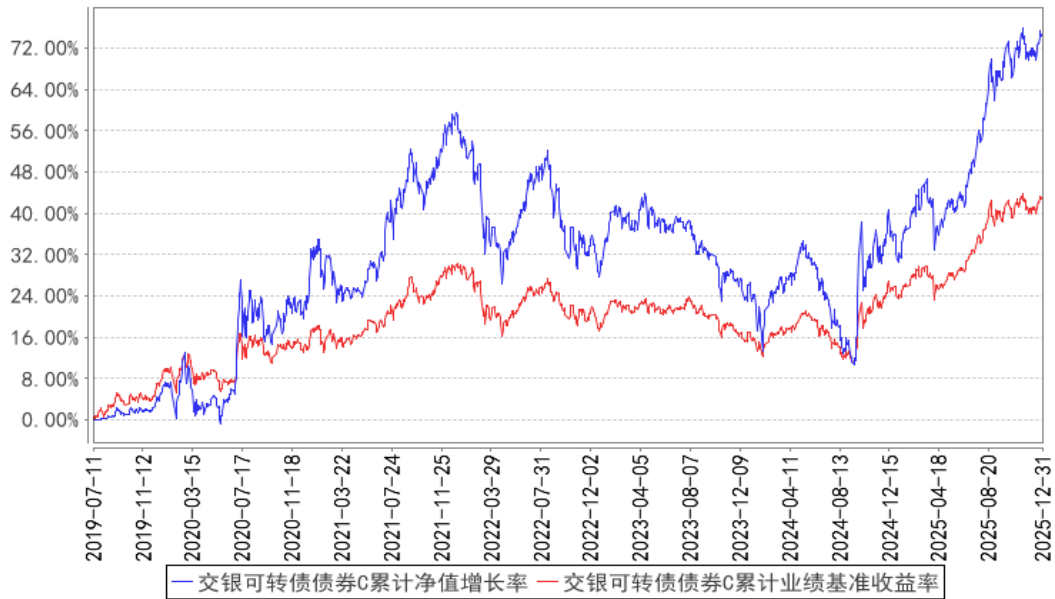
注：本基金业绩比较基准为中证可转换债券指数收益率*70%+中债综合全价指数收益率*20%+沪深300 指数收益率*10%，每日进行再平衡过程。

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

交银可转债债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



交银可转债债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§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 | | |
| 魏玉敏 | 交银增利债券、交银增利增 | 2019 年 7 月 11 日 | — | 13 年 | 硕士。历任招商证券固定收益研究员、国信证券固定收益高级分析师。2016 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历 |

| | | | | | |
|-----|--|----------------|---|-----|---|
| | 强债券、交银可转债债券、交银安心收益债券、交银双利债券、交银强化回报债券、交银定期支付月月丰债券、交银优选回报灵活配置混合、交银 180 天持有期债券的基金经理 | | | | 任固定收益部基金经理助理/基金经理。 |
| 王丽婧 | 交银可转债债券、交银鸿福六个月混合、交银稳进回报六个月持有期混合的基金经理 | 2025 年 1 月 8 日 | - | 8 年 | 硕士。历任华商基金管理有限公司研究员。2018 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任固定收益部研究员/基金经理助理、混合资产投资部基金经理助理。 |

注：基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

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》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金整体运作符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循公平交易分配原则对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量 5% 的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾 2025 年四季度，债市收益率先下后上，期限利差继续走阔。截至 12 月 31 日，1 年国债和 10 年国债均较季初小幅下行。权益市场方面，行情整体呈现 N 型走势。10 月主要指数震荡偏强，中上旬受贸易摩擦再起等因素影响市场波动加大，红利价值板块成为避风港，月末中美经贸谈判达成阶段性成果，市场信心修复。11 到 12 月 A 股先跌后涨，中央经济工作会议和美联储议息会议前预期扰动，市场呈波动态势，随着重大会议落地，市场稳步上涨。转债市场方面，四季度转债指数和估值均震荡上行。10 月转债小幅收跌，百元平价溢价率小幅下行，高价券承压。11 月转债跌幅小于正股，转债估值略有走阔，涨幅靠前标的均为资源品涨价逻辑。12 月转债跟随权益上涨，估值继续走阔，整体估值处于较高位置。操作方面兼顾短期波动控制与中长期收益获取。报告期内，组合继续维持高比例的转债和股票资产配置，具备较高的权益敞口，但结构上做了一定的调整，尤其是转债部分的结构更偏防守。转债个券选择上关注正股景气度和基本面的变化，由于整体转债估值水平不低，组合分散配置了波动率较大的双低类转债，转债仓位的平均价格属于中性水平。权益资产的配置上均衡配置了价值和成长，由于股票市场可挖掘的机会

多于转债，仓位上略有提升，布局了跟踪到的个股基本面有边际变化或者景气度有提升的中小盘标的，尤其是转债对应的正股公司。

2025 年交银基金投研平台建设根据市场情况继续推进，目前已实现系统化机制：各研究组按资产特征及投资视角分域赋能，为组合贡献多元、低相关的收益来源，提升投研输出连续性和稳定性；多资产研究团队提供资产配置建议，动态监控波动率及对冲效果，同时与权益团队协作深化中观及微观视角；公司平台在产品运作中嵌入过程管理监控，以投前测算、投中跟踪、投后归因全流程持续优化持有体验，并对组合持仓风格、行业、波动分布进行动态跟踪，关注基金投资策略、投资行为和产品目标的一致性。

展望 2026 年一季度，我们对整体市场环境保持乐观态度，不同资产类别将呈现差异化的运行特征，具体展望如下：股票市场方面，我们整体保持积极态度，但预计市场上涨方向将发生明显变化，结构性机会将成为主导。从市场风格来看，前期成长板块独领风骚的格局难以持续，随着资金对盈利确定性的追求提升，价值风格有望持续占优，同时市场将从普涨转向精选个股的阶段，具备估值优势、盈利稳定增长的优质企业将获得更多资金青睐。债券市场方面，我们维持中性偏悲观的展望，后续收益率下行空间有限，且随着经济复苏动能增强，未来存在利率上行的潜在压力。整体来看，债券市场后续大概率呈现震荡偏弱格局。转债市场方面，当前估值偏高的格局短期内难以根本性改变，但供需偏紧的格局仍将为估值提供一定支撑，市场仍存在结构性超额收益机会。需警惕权益市场风格切换带来的估值回调压力，以及部分高估值标的因正股走弱引发的价格波动风险。后续操作中，本基金将继续秉持稳健的投资理念，密切跟踪宏观经济走势、政策变化及市场情绪波动，动态调整组合仓位与结构。权益方面，持续聚焦价值风格，深挖优质价值股的投资机会；转债方面，保持谨慎乐观的态度，积极进行结构上的调整，力争为基金份额持有人实现长期稳健的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要财务指标”及“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”部分披露。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§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 | 44,538,331.96 | 26.83 |
| | 其中：股票 | 44,538,331.96 | 26.83 |
| 2 | 基金投资 | — | — |
| 3 | 固定收益投资 | 117,981,508.65 | 71.07 |
| | 其中：债券 | 117,981,508.65 | 71.07 |
| | 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 | 2,071,218.36 | 1.25 |
| 8 | 其他资产 | 1,412,271.85 | 0.85 |
| 9 | 合计 | 166,003,330.82 | 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 | 32,341,784.54 | 23.49 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,117,770.00 | 0.81 |
| E | 建筑业 | 518,976.00 | 0.38 |
| F | 批发和零售业 | 697,212.00 | 0.51 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,812,768.00 | 1.32 |
| H | 住宿和餐饮业 | — | — |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,400,578.42 | 3.92 |
| J | 金融业 | 644,360.00 | 0.47 |
| K | 房地产业 | — | — |
| L | 租赁和商务服务业 | 866,286.00 | 0.63 |
| M | 科学研究和技术服务业 | — | — |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 465,792.00 | 0.34 |
| 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 | 672,805.00 | 0.49 |
| S | 综合 | — | — |

| | | | |
|--|----|---------------|-------|
| | 合计 | 44,538,331.96 | 32.35 |
|--|----|---------------|-------|

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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 | 600233 | 圆通速递 | 110,400 | 1,812,768.00 | 1.32 |
| 2 | 603187 | 海容冷链 | 106,100 | 1,664,709.00 | 1.21 |
| 3 | 000997 | 新大陆 | 51,300 | 1,452,816.00 | 1.06 |
| 4 | 002833 | 弘亚数控 | 82,800 | 1,355,436.00 | 0.98 |
| 5 | 603171 | 税友股份 | 24,500 | 1,350,685.00 | 0.98 |
| 6 | 300893 | 松原安全 | 55,580 | 1,313,911.20 | 0.95 |
| 7 | 689009 | 九号公司 | 22,981 | 1,277,513.79 | 0.93 |
| 8 | 300001 | 特锐德 | 47,900 | 1,230,072.00 | 0.89 |
| 9 | 002475 | 立讯精密 | 20,300 | 1,151,213.00 | 0.84 |
| 10 | 002078 | 太阳纸业 | 71,100 | 1,119,825.00 | 0.81 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 7,558,554.59 | 5.49 |
| 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） | 110,422,954.06 | 80.21 |
| 8 | 同业存单 | — | — |
| 9 | 其他 | — | — |
| 10 | 合计 | 117,981,508.65 | 85.70 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 113052 | 兴业转债 | 131,570 | 15,885,130.99 | 11.54 |
| 2 | 127025 | 冀东转债 | 134,056 | 14,160,316.92 | 10.29 |
| 3 | 113042 | 上银转债 | 92,440 | 11,745,046.51 | 8.53 |
| 4 | 127108 | 太能转债 | 53,310 | 6,519,402.59 | 4.74 |
| 5 | 127083 | 山路转债 | 37,612 | 4,605,294.69 | 3.35 |

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

无。

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

无。

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

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情形披露如下：

2025 年 01 月 02 日，国家金融监督管理总局上海监管局公示沪金罚决字[2024]236 号行政处罚决定书，给予上海银行股份有限公司 200 万元人民币的行政处罚。

2025 年 03 月 28 日，央行公示银罚决字[2025]2 号行政处罚决定书，给予上海银行股份有限公司 110 万元人民币的行政处罚。

2025 年 08 月 01 日，央行公示银罚决字[2025]10 号行政处罚决定书，给予上海银行股份有限公司 2921.75 万元人民币的行政处罚。

2025 年 12 月 05 日，国家金融监督管理总局公示行政处罚，给予兴业银行股份有限公司 720 万元人民币的行政处罚。

本基金管理人对证券投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资特别是重仓证券的

投资有严格的投资决策流程控制，对上述主体发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期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。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 51,864.67 |
| 2 | 应收证券清算款 | 619,941.39 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | — |
| 5 | 应收申购款 | 740,465.79 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 其他 | — |
| 8 | 合计 | 1,412,271.85 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------------|--------------|
| 1 | 113052 | 兴业转债 | 15,885,130.99 | 11.54 |
| 2 | 127025 | 冀东转债 | 14,160,316.92 | 10.29 |
| 3 | 113042 | 上银转债 | 11,745,046.51 | 8.53 |
| 4 | 127108 | 太能转债 | 6,519,402.59 | 4.74 |
| 5 | 127083 | 山路转债 | 4,605,294.69 | 3.35 |
| 6 | 127056 | 中特转债 | 4,299,156.57 | 3.12 |
| 7 | 132026 | G 三峡 EB2 | 3,819,113.32 | 2.77 |
| 8 | 113652 | 伟 22 转债 | 3,561,136.17 | 2.59 |
| 9 | 127092 | 运机转债 | 2,902,342.51 | 2.11 |
| 10 | 127049 | 希望转 2 | 2,814,058.21 | 2.04 |
| 11 | 110086 | 精工转债 | 2,292,928.25 | 1.67 |
| 12 | 127061 | 美锦转债 | 1,965,726.86 | 1.43 |
| 13 | 118030 | 睿创转债 | 1,903,037.63 | 1.38 |
| 14 | 110087 | 天业转债 | 1,612,787.75 | 1.17 |
| 15 | 123216 | 科顺转债 | 1,438,620.71 | 1.04 |
| 16 | 127103 | 东南转债 | 1,419,747.81 | 1.03 |
| 17 | 113658 | 密卫转债 | 1,385,061.61 | 1.01 |
| 18 | 110089 | 兴发转债 | 1,314,344.18 | 0.95 |
| 19 | 118034 | 晶能转债 | 1,258,974.74 | 0.91 |
| 20 | 113039 | 嘉泽转债 | 1,125,010.55 | 0.82 |

| | | | | |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 21 | 123251 | 华医转债 | 1,096,001.78 | 0.80 |
| 22 | 111010 | 立昂转债 | 1,074,181.22 | 0.78 |
| 23 | 127060 | 湘佳转债 | 1,023,975.80 | 0.74 |
| 24 | 118010 | 洁特转债 | 990,350.03 | 0.72 |
| 25 | 118031 | 天 23 转债 | 806,265.00 | 0.59 |
| 26 | 123254 | 亿纬转债 | 746,513.49 | 0.54 |
| 27 | 113644 | 艾迪转债 | 740,227.89 | 0.54 |
| 28 | 111018 | 华康转债 | 711,602.51 | 0.52 |
| 29 | 113691 | 和邦转债 | 685,676.71 | 0.50 |
| 30 | 113647 | 禾丰转债 | 684,028.89 | 0.50 |
| 31 | 111015 | 东亚转债 | 664,328.86 | 0.48 |
| 32 | 127099 | 盛航转债 | 644,391.87 | 0.47 |
| 33 | 118008 | 海优转债 | 592,783.65 | 0.43 |
| 34 | 123178 | 花园转债 | 567,642.85 | 0.41 |
| 35 | 113694 | 清源转债 | 549,539.17 | 0.40 |
| 36 | 113632 | 鹤 21 转债 | 544,613.65 | 0.40 |
| 37 | 111000 | 起帆转债 | 472,254.29 | 0.34 |
| 38 | 113670 | 金 23 转债 | 466,043.24 | 0.34 |
| 39 | 118051 | 皓元转债 | 453,262.59 | 0.33 |
| 40 | 123252 | 银邦转债 | 444,490.87 | 0.32 |
| 41 | 123199 | 山河转债 | 439,692.28 | 0.32 |
| 42 | 113679 | 芯能转债 | 439,473.88 | 0.32 |
| 43 | 113651 | 松霖转债 | 424,139.10 | 0.31 |
| 44 | 123247 | 万凯转债 | 421,893.03 | 0.31 |
| 45 | 118012 | 微芯转债 | 417,172.98 | 0.30 |
| 46 | 127082 | 亚科转债 | 416,732.32 | 0.30 |
| 47 | 118009 | 华锐转债 | 413,107.80 | 0.30 |
| 48 | 118018 | 瑞科转债 | 364,455.72 | 0.26 |
| 49 | 113625 | 江山转债 | 363,387.60 | 0.26 |
| 50 | 127075 | 百川转 2 | 349,145.37 | 0.25 |
| 51 | 118035 | 国力转债 | 348,199.58 | 0.25 |
| 52 | 110097 | 天润转债 | 342,823.14 | 0.25 |
| 53 | 113643 | 风语转债 | 320,032.75 | 0.23 |
| 54 | 118000 | 嘉元转债 | 319,857.10 | 0.23 |
| 55 | 123158 | 宙邦转债 | 318,975.21 | 0.23 |
| 56 | 111021 | 奥锐转债 | 310,416.41 | 0.23 |
| 57 | 123237 | 佳禾转债 | 290,391.38 | 0.21 |
| 58 | 113640 | 苏利转债 | 289,194.00 | 0.21 |
| 59 | 123215 | 铭利转债 | 285,335.38 | 0.21 |
| 60 | 113655 | 欧 22 转债 | 281,774.20 | 0.20 |
| 61 | 118015 | 芯海转债 | 280,406.32 | 0.20 |
| 62 | 113045 | 环旭转债 | 273,332.82 | 0.20 |

| | | | | |
|----|--------|---------|------------|------|
| 63 | 113672 | 福蓉转债 | 268,303.79 | 0.19 |
| 64 | 113653 | 永 22 转债 | 266,372.71 | 0.19 |
| 65 | 123168 | 惠云转债 | 248,269.71 | 0.18 |
| 66 | 127034 | 绿茵转债 | 245,142.75 | 0.18 |
| 67 | 127105 | 龙星转债 | 244,967.25 | 0.18 |
| 68 | 127037 | 银轮转债 | 214,165.18 | 0.16 |
| 69 | 123171 | 共同转债 | 213,454.56 | 0.16 |
| 70 | 128134 | 鸿路转债 | 184,051.39 | 0.13 |
| 71 | 113676 | 荣 23 转债 | 138,578.68 | 0.10 |

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 交银可转债债券 A | 交银可转债债券 C |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 51,523,720.19 | 31,552,143.20 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 18,044,712.41 | 17,952,934.25 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 23,494,301.47 | 18,078,543.55 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 46,074,131.13 | 31,426,533.90 |

注：1、如果本报告期间发生转换入、份额类别调整、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出、份额类别调整业务，则总赎回份额中包含该业务。

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据有关法律法规及本基金基金合同的有关规定，本基金管理人于 2025 年 12 月 24 日起将存托凭证纳入本基金的投资范围、修改转换条款，并相应修改基金合同等法律文件，欲知详情请查阅本基金管理人发布的最新法律文件。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予交银施罗德可转债债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《交银施罗德可转债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德可转债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德可转债债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册交银施罗德可转债债券型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内交银施罗德可转债债券型证券投资基金在规定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。