

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
2026 年中期报告
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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 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	1
2.1 基金基本情况	1
2.2 基金产品说明	1
2.3 基金管理人和基金托管人	2
2.4 信息披露方式	2
2.5 其他相关资料	2
§3 主要财务指标和基金净值表现	3
3.1 主要会计数据和财务指标	3
3.2 基金净值表现	3
§4 管理人报告	4
4.1 基金管理人及基金经理情况	4
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	7
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	7
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
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合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	42
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	42
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	42
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	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	43
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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的情况	51
§9 开放式基金份额变动	51

§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
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	52
10.8 其他重大事件	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时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 博时
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	4,320,886,670.00 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	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。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债足够数量的投资时，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。

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	张姗
	联系电话	0755-83169999	400-61-95555
	电子邮箱	service@bosera.com	zhangshan_1027@cmbchina.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		张东	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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://www.bosera.com
基金中期报告置备地点	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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	2,769,723,706.58
本期利润	817,868,723.99
加权平均基金份额本期利润	0.1866
本期加权平均净值利润率	1.31%
本期基金份额净值增长率	2.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	15,034,016,437.80
期末可供分配基金份额利润	3.4794
期末基金资产净值	60,424,050,400.91
期末基金份额净值	13.9842
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	39.84%

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。

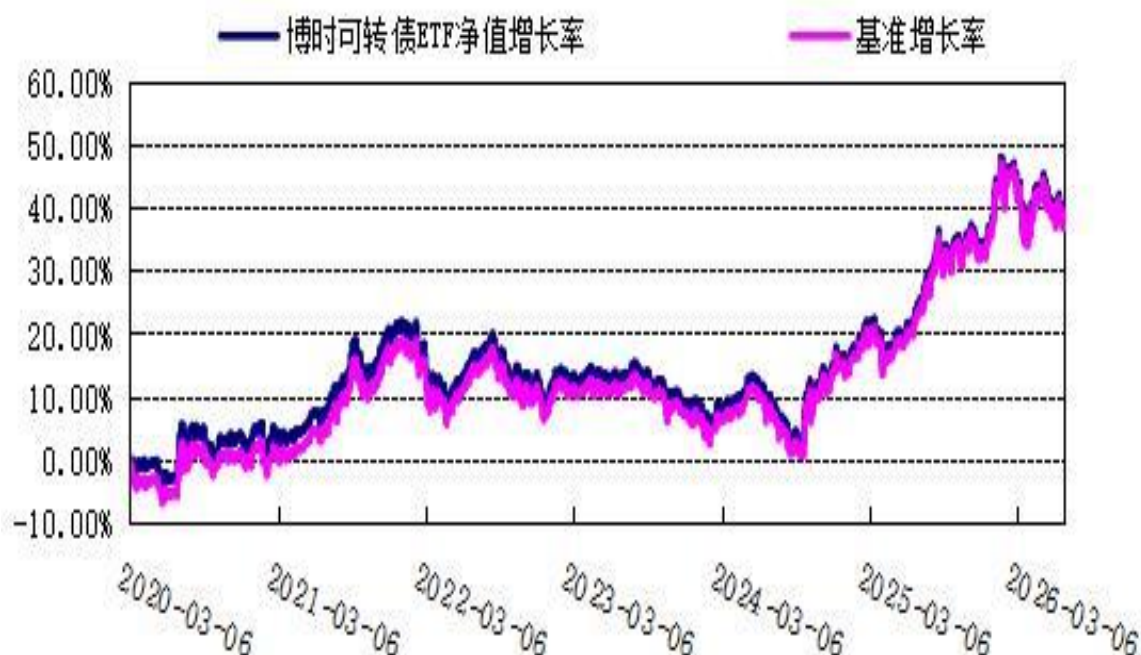
3.2 基金净值表现

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	3.43%	0.84%	3.56%	0.85%	-0.13%	-0.01%

过去六个月	2.27%	0.93%	2.38%	0.94%	-0.11%	-0.01%
过去一年	12.75%	0.79%	13.18%	0.79%	-0.43%	0.00%
过去三年	23.47%	0.63%	24.76%	0.64%	-1.29%	-0.01%
过去五年	29.77%	0.60%	32.44%	0.61%	-2.67%	-0.01%
自基金合同生效起至今	39.84%	0.59%	38.98%	0.60%	0.86%	-0.01%

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 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，管理资产总规模逾 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。

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	-	15.2	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	-	24.9	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	-	7.9	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 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 18 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

2026 年上半年，国内经济运行的核心特征是总量保持韧性、增长动能分化加深。上半年国内生产总值同比增长 4.7%，其中一季度增长 5.0%、二季度增长 4.3%，经济修复斜率有所放缓。从需求和生产两端看，外需与工业生产是主要支撑：上半年出口金额同比增长 17.6%，规模以上工业增加值增长 5.4%，计算机通信电子、运输设备等先进制造领域保持较高景气；与之相对，社会消费品零售总额增长 1.3%，固定资产投资下降 5.7%，内需及投资端仍面临一定压力。价格方面，上半年 CPI 累计同比上涨 1.0%，PPI 累计同比上涨 1.5%，价格环境较此前有所改善，但尚未转化为内需的全面扩张。6 月末 M2 同比增长 8.0%，流动性环境保持合理充裕。整体而言，上半年经济呈现“生产强于需求、外需强于内需、新动能强于传统动能”的

结构，宏观政策继续发挥托底作用，但经济内生需求仍有进一步修复空间。

资本市场对上述基本面组合的定价并非线性展开。一季度初，政策预期和流动性环境推动风险偏好上升，市场交易重心集中于正股景气度较高、成交活跃的方向；此后，中东地缘局势、能源价格上涨及海外货币政策预期变化抬升了全球资产波动，A 股由上涨转为调整。进入二季度，虽然国内经济总量数据边际放缓，但充裕的流动性、无风险利率下行以及产业层面的结构性景气共同支撑权益市场修复，市场定价重心由总量增长转向结构性盈利和风险偏好。上半年沪深 300 指数上涨 7.55%，中证 1000 指数上涨 15.99%，中小盘和成长风格明显占优，但指数上涨背后行业与个股分化较大，科技成长等少数高景气方向贡献较为集中。债券市场则在资金面宽松和内需偏弱的支持下总体震荡走强，收益率曲线有所下移，短端表现相对稳定；长端利率受到政府债供给、权益市场回升、通胀预期及海外扰动等因素交替影响，波动明显高于短端。由此，上半年股债市场并非简单的风险偏好单边交易，而是围绕流动性、政策预期、基本面修复斜率和结构性景气反复定价。

可转债市场在这一环境下呈现 M 型走势、结构分化大于指数波动的特征。中证转债及可交换债指数一季度下跌 1.14%，二季度上涨 3.56%，上半年累计上涨 2.38%。年初至 2 月，权益市场风险偏好较高，资金向成交活跃、正股表现强势及主题属性突出的转债集中，股性逻辑主导个券表现；3 月以后，随着权益市场调整、强赎事件增多和外部不确定性上升，转债定价阶段性由股性进攻转向债性防御。二季度权益市场明显修复，但转债指数弹性弱于主要股票指数，反映出转债估值、赎回约束及样本结构对上涨弹性的制约。特别是 5 月至 6 月，正股行情进一步向科技成长方向集中，转债市场内部的 K 型分化随之加深，高平价、正股弹性较强的品种表现突出，低评级品种在风险偏好回升阶段也体现出较高弹性，而以银行转债为代表的评级高、低弹性品种相对落后。

报告期内，部分转债因正股被实施风险警示、退市预期上升而出现信用风险扩散，传统意义上的债底保护在部分个券上有所弱化；与此同时，高平价品种虽然受益于正股上涨，但也面临强赎概率上升和转债生命周期缩短的约束。二季度末转债价格中位数回落至 130 元以内，表面上看整体价格压力有所缓解，但不同个券的估值驱动已明显分化：高价券主要由正股弹性决定，低价券则更依赖发行人信用资质和偿付能力，单纯依据绝对价格判断安全边际的有效性下降。因此，上半年转债投资的核心矛盾已从单一估值高低，转向正股景气、转债估值、信用资质和赎回条款之间的综合权衡。

供需方面，上半年新券发行节奏总体偏慢，虽然二季度转债预案发布和交易所审核有所提速，但强赎、到期及退市个券数量增加，存量市场规模继续收缩。传统“固收+”产品的转债配置意愿相对有限，而可转债 ETF、可转债基金及一级债基等产品的负债端稳定性较好，为市场提供了持续的配置需求。供给收缩与结构性需求共同维持了转债估值韧性，但也进一步强化了资金向流动性较好、正股逻辑清晰品种集中的特征。市场整体并未出现系统性信用收缩，但低价券信用风险的扩散说明，转债市场的尾部风险较过去有所

上升。

本基金为被动跟踪中证可转债及可交换债券指数的交易型开放式指数证券投资基金。报告期内，我们继续以控制跟踪偏离度和跟踪误差为核心，依据标的指数成份券及权重变化管理组合，并结合基金规模、申购赎回、成份券流动性和市场交易成本进行动态优化。在基金合同允许及跟踪误差可控的范围内，对价格极度虚高、流动性不足的少数成份券实施适当替代，及时降低或剔除存在退市及实质性信用风险的个券，避免个别风险事件对组合造成过度影响。针对上半年市场成交活跃、强赎和指数成份调整较多的特点，我们合理安排交易节奏，统筹处理指数调整和日常申购赎回需求，努力降低买卖价差、冲击成本及非必要换手。报告期内，组合结构与标的指数总体保持一致，一季度可转债 ETF 规模显著增长、二级市场成交额继续提升，二季度基金规模及场内成交总体保持平稳，基金整体运作平稳。

4.4.2 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 13.9842 元，份额累计净值为 1.3984 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 2.27%，同期业绩基准增长率为 2.38%。

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，国内经济预计仍将保持韧性，但内外需分化和新旧动能转换可能继续成为宏观运行的主要特征。上半年经济增长更多依靠出口、工业生产和新兴产业支撑，消费及固定资产投资相对偏弱，二季度经济增速较一季度有所放缓。预计宏观政策将更加注重扩大内需、稳定投资和改善市场预期，财政支出、设备更新、消费支持以及重点领域投资有望继续发挥托底作用。出口在我国制造业竞争力和全球需求支撑下仍具韧性，但高基数、贸易政策变化及地缘政治扰动可能加大下半年波动。通胀方面，PPI 已出现改善迹象，但其持续性仍取决于国内需求修复、国际能源价格和工业品供需格局，出口走势与通胀变化仍是影响货币政策节奏的重要变量。

货币政策预计继续保持适度宽松，流动性环境仍有望维持合理充裕，但随着短端收益率已降至相对低位，债券市场进一步上涨的空间可能更多依赖基本面走弱或政策利率下调。长端利率将继续受到政府债券供给、经济修复预期、权益市场风险偏好以及海外通胀等多重因素影响，预计债券市场仍以区间震荡为主，收益率曲线可能呈现阶段性陡峭化特征。低利率环境一方面对转债的债底估值形成支持，另一方面也将继续推动居民及机构资金寻找含权资产，居民大类资产由存款、理财向权益及多元化资产配置迁移的中长期趋势预计不会发生根本改变。

权益市场方面，上半年主要宽基指数已经取得一定涨幅，市场估值较年初有所修复，下半年行情可能由风险偏好驱动逐步转向盈利兑现和基本面验证。国内流动性保持宽松、资本市场政策持续完善以及居民资产再配置，仍将对权益资产估值形成支撑；但经济修复并不均衡，海外货币政策、能源价格和地缘政治

仍存在不确定性，市场波动可能较上半年进一步加大。预计 A 股仍以震荡中的结构性机会为主，指数层面的持续上涨需要上市公司盈利改善予以配合，市场风格也可能由上半年的集中交易逐步转向对业绩增长质量、估值匹配度和现金流的综合考量。

转债方面，权益市场维持结构性慢牛行情、无风险利率、信用利差长期处于低位以及转债存量规模持续收缩，均有利于转债估值保持一定韧性。但转债绝对价格和转股溢价率仍处于历史相对高位，资产整体的安全边际有限，交易属性仍可能重于配置属性。随着部分大盘 AAA 转债到期或赎回，转债市场中小盘化和高波动特征预计进一步增强。同时，供需矛盾可能支撑估值高位运行，也可能放大估值脆弱性及双向波动。

下半年转债市场的核心风险在于权益行情与转债估值可能出现不同步调整。高平价品种在正股上涨时具备较强弹性，但同时面临强赎概率上升和生命周期缩短的约束；低价品种则需要更加关注发行人经营状况、偿付能力、退市风险及流动性，绝对价格较低并不必然代表具有充分的债底保护。预计市场分化仍将延续，正股基本面、转债估值、信用资质和条款博弈将共同决定个券表现。总体而言，下半年转债指数仍有望受益于权益市场的结构性机会和供需格局支撑，但在估值不低、信用风险分化及外部扰动增加的环境下，市场波动可能维持较高水平。

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验。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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.6.1	142,557,585.02	267,158,638.98
结算备付金		100,717,584.63	77,903,037.63
存出保证金		3,557,975.85	3,945,553.69
交易性金融资产	6.4.6.2	59,996,051,615.13	51,031,559,244.58
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		59,996,051,615.13	51,031,559,244.58
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	365,000,000.00	595,824,437.68
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		264,494,245.91	360,621,453.73
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	60,492.63	-
资产总计		60,872,439,499.17	52,337,012,366.29

负债和净资产	附注号	本期末 2026年6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	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		435,685,814.20	441,730,042.28
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,766,896.85	6,996,938.55
应付托管费		2,588,965.61	2,332,312.83
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,297,234.29	1,215,720.63
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	1,050,187.31	2,306,213.11
负债合计		448,389,098.26	454,581,227.40
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	43,208,869,197.03	37,942,868,887.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	17,215,181,203.88	13,939,562,251.89
净资产合计		60,424,050,400.91	51,882,431,138.89
负债和净资产总计		60,872,439,499.17	52,337,012,366.29

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 13.9842 元，基金份额总额 4,320,886,670.00 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026年1月1日至2026 年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30 日
一、营业总收入		880,589,445.10	2,560,627,698.68
1.利息收入		6,133,620.08	4,386,402.57
其中：存款利息收入	6.4.6.9	1,491,833.83	567,875.57
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		4,641,786.25	3,818,527.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,794,473,556.67	1,348,589,807.10
其中：股票投资收益	6.4.6.10	-54,181,682.83	-8,028,175.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.11	2,848,655,239.50	1,356,617,982.71
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	-1,951,854,982.59	1,181,497,863.60
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	31,837,250.94	26,153,625.41
减：二、营业总支出		62,720,721.11	39,366,161.47

1. 管理人报酬		46,271,684.88	27,725,349.84
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		15,423,894.97	9,241,783.29
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		830,141.05	465,753.85
8. 其他费用	6.4.6.18	195,000.21	1,933,274.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		817,868,723.99	2,521,261,537.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		817,868,723.99	2,521,261,537.21
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		817,868,723.99	2,521,261,537.21

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026年1月1日至2026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	37,942,868,887.00	-	13,939,562,251.89	51,882,431,138.89
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	37,942,868,887.00	-	13,939,562,251.89	51,882,431,138.89
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	5,266,000,310.03	-	3,275,618,951.99	8,541,619,262.02
(一)、综合收益总额	-	-	817,868,723.99	817,868,723.99
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	5,266,000,310.03	-	2,457,750,228.00	7,723,750,538.03
其中：1.基金申购款	20,383,001,178.75	-	8,674,468,398.59	29,057,469,577.34
2.基金赎回款	-15,117,000,868.72	-	-6,216,718,170.59	-21,333,719,039.31
(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	43,208,869,197.03	-	17,215,181,203.88	60,424,050,400.91

项目	上年度可比期间			
	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

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：张东，主管会计工作负责人：吴慧峰，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[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。

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 2026年6月30日
活期存款	142,557,585.02
等于：本金	142,505,259.99
加：应计利息	52,325.03
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	142,557,585.02

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026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	57,511,620,737.35	346,628,524.87	59,996,051,615.13	2,137,802,352.91
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	57,511,620,737.35	346,628,524.87	59,996,051,615.13	2,137,802,352.91
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		57,511,620,737.35	346,628,524.87	59,996,051,615.13	2,137,802,352.91

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 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	365,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	365,000,000.00	-

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 2026年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

6.4.6.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026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	916,131.97
其中：交易所市场	916,131.97
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,138.35
应付 IOPV 计算与发布费	29,916.99
合计	1,050,187.31

6.4.6.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,794,286,670.00	37,942,868,887.00
本期申购	2,038,300,000.00	20,383,001,178.75
本期赎回（以“-”号填列）	-1,511,700,000.00	-15,117,000,868.72
本期末	4,320,886,670.00	43,208,869,197.03

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	10,797,272,855.09	3,142,289,396.80	13,939,562,251.89
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	10,797,272,855.09	3,142,289,396.80	13,939,562,251.89
本期利润	2,769,723,706.58	-1,951,854,982.59	817,868,723.99
本期基金份额交易产生的变动数	1,467,019,876.13	990,730,351.87	2,457,750,228.00
其中：基金申购款	6,357,411,379.17	2,317,057,019.42	8,674,468,398.59
基金赎回款	-4,890,391,503.04	-1,326,326,667.55	-6,216,718,170.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,034,016,437.80	2,181,164,766.08	17,215,181,203.88

6.4.6.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,329,912.46

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	155,504.99
其他	6,416.38
合计	1,491,833.83

6.4.6.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	7,836,042,250.87
减：卖出股票成本总额	7,884,190,055.14
减：交易费用	6,033,878.56
买卖股票差价收入	-54,181,682.83

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	332,268,221.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,516,387,018.13
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	2,848,655,239.50

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 2026年1月1日至2026年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	33,262,934,705.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	30,540,137,434.87
减：应计利息总额	203,809,380.75
减：交易费用	2,600,871.30
买卖债券差价收入	2,516,387,018.13

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 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	21,333,719,039.31
减：现金支付赎回款总额	21,333,719,039.31
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 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-1,951,854,982.59
——股票投资	-
——债券投资	-1,951,854,982.59
——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	-1,951,854,982.59

6.4.6.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	31,837,250.94
合计	31,837,250.94

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 2026年1月1日至2026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	21,437.50
中登注册登记费	59,507.37
IOPV 计算与发布费	9,916.99
合计	195,000.21

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

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方、关联关系

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总 额的比例
招商证券	2,363,164,742.10	30.16%	-	-

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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	20,817,035,468.09	31.11%	5,943,242,633.30	22.00%

6.4.9.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例	成交金额	占当期债券回购成 交总额的比例
招商证券	21,155,000,000.00	27.50%	-	-

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额 的比例

招商证券	486,548.16	30.16%	253,216.24	27.64%
关联方名称	上年度可比期间			
	2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额 的比例
-	-	-	-	-

注：1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	46,271,684.88	27,725,349.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	781,656.19	104,327.75
应支付基金管理人的净管理费	45,490,028.69	27,621,022.09

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 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,423,894.97	9,241,783.29

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 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
招商证券	2,972,350.00	0.07%	2,037,408.00	0.05%

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		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日	2025年1月1日至2025年6月30日	2025年1月1日至2025年6月30日	2025年1月1日至2025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	142,557,585.02	1,329,912.46	686,128,629.51	455,595.00

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（2026 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

金额单位：人民币元

6.4.11.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113703	翔 26 转债	2026-06-11	17 个交易日	新债未上市	100.00	100.01	10.00	1,000.00	1,000.13	-

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的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；法律合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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

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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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 2026年6月30日	上年末 2025年12月31日
AAA	20,710,616,667.35	16,490,006,707.08
AAA 以下	38,651,074,923.25	34,541,552,326.78
未评级	634,360,025.75	-
合计	59,996,051,616.35	51,031,559,033.86

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同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运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	142,557,585.02	-	-	-	142,557,585.02
结算备付金	100,717,584.63	-	-	-	100,717,584.63
存出保证金	3,557,975.85	-	-	-	3,557,975.85
交易性金融资产	12,989,244,126.43	39,407,558,181.54	7,599,249,307.16	-	59,996,051,615.13
应收清算款	-	-	-	264,494,245.91	264,494,245.91
买入返售金融资产	365,000,000.00	-	-	-	365,000,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	13,601,077,271.93	39,407,558,181.54	7,599,249,307.16	264,554,738.54	60,872,439,499.17
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	435,685,814.20	435,685,814.20
应付管理人报酬	-	-	-	7,766,896.85	7,766,896.85
应付托管费	-	-	-	2,588,965.61	2,588,965.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,297,234.29	1,297,234.29
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,050,187.31	1,050,187.31
负债总计	-	-	-	448,389,098.26	448,389,098.26
利率敏感度缺口	13,601,077,271.93	39,407,558,181.54	7,599,249,307.16	-183,834,359.72	60,424,050,400.91
上年度末 2025 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
货币资金	267,158,638.98	-	-	-	267,158,638.98
结算备付金	77,903,037.63	-	-	-	77,903,037.63
存出保证金	3,945,553.69	-	-	-	3,945,553.69
交易性金融资产	7,039,910,046.80	38,920,523,420.27	5,071,125,777.51	-	51,031,559,244.58
应收清算款	-	-	-	360,621,453.73	360,621,453.73
买入返售金融资产	595,824,437.68	-	-	-	595,824,437.68
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,984,741,714.78	38,920,523,420.27	5,071,125,777.51	360,621,453.73	52,337,012,366.29
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	441,730,042.28	441,730,042.28
应付管理人报酬	-	-	-	6,996,938.55	6,996,938.55
应付托管费	-	-	-	2,332,312.83	2,332,312.83
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,215,720.63	1,215,720.63
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,306,213.11	2,306,213.11
负债总计	-	-	-	454,581,227.40	454,581,227.40
利率敏感度缺口	7,984,741,714.78	38,920,523,420.27	5,071,125,777.51	-93,959,773.67	51,882,431,138.89

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和资产支持证券投资(不包括可转债和可交换债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	59,996,051,615.13	99.29	51,031,559,244.58	98.36
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	59,996,051,615.13	99.29	51,031,559,244.58	98.36

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下，期

货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为 0。

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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 315,668	增加约 383,021
	业绩比较基准下降 5%	减少约 315,668	减少约 383,021

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 2026年6月30日
第一层次	59,959,154,718.35
第二层次	36,896,896.78
第三层次	-
合计	59,996,051,615.13

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	59,996,051,615.13	98.56
	其中：债券	59,996,051,615.13	98.56
	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	365,000,000.00	0.60
	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	243,275,169.65	0.40
8	其他各项资产	268,112,714.39	0.44

9	合计	60,872,439,499.17	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

无。

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	605358	立昂微	641,320,375.20	1.24
2	300014	亿纬锂能	510,371,872.12	0.98
3	601231	环旭电子	409,498,074.61	0.79
4	603225	新凤鸣	292,369,979.91	0.56
5	600141	兴发集团	287,973,263.15	0.56
6	000967	盈峰环境	267,108,560.60	0.51
7	000703	恒逸石化	253,980,130.95	0.49
8	688362	甬矽电子	221,402,111.30	0.43
9	688372	伟测科技	202,206,507.34	0.39
10	002850	科达利	186,854,221.81	0.36
11	688301	奕瑞科技	171,911,564.49	0.33
12	002455	百川股份	171,549,997.60	0.33
13	002859	洁美科技	165,919,747.20	0.32
14	603067	振华股份	160,630,862.16	0.31
15	688403	汇成股份	151,751,690.77	0.29
16	300483	首华燃气	151,549,271.35	0.29
17	601137	博威合金	150,704,085.35	0.29
18	688001	华兴源创	134,980,521.06	0.26
19	300776	帝尔激光	132,920,522.08	0.26

20	688106	金宏气体	130,627,163.85	0.25
----	--------	------	----------------	------

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	605358	立昂微	693,171,434.49	1.34
2	300014	亿纬锂能	502,882,079.91	0.97
3	601231	环旭电子	404,195,577.26	0.78
4	603225	新凤鸣	294,663,950.28	0.57
5	600141	兴发集团	290,161,447.10	0.56
6	000703	恒逸石化	247,897,333.58	0.48
7	000967	盈峰环境	235,211,884.92	0.45
8	688362	甬矽电子	209,840,537.66	0.40
9	688372	伟测科技	206,561,797.78	0.40
10	002859	洁美科技	189,588,288.77	0.37
11	002850	科达利	180,298,390.73	0.35
12	688301	奕瑞科技	166,398,190.13	0.32
13	002455	百川股份	164,688,502.59	0.32
14	688403	汇成股份	161,103,239.77	0.31
15	603067	振华股份	151,640,004.59	0.29
16	300483	首华燃气	151,073,077.39	0.29
17	601137	博威合金	149,249,910.61	0.29
18	688001	华兴源创	140,574,133.69	0.27
19	300776	帝尔激光	135,213,127.15	0.26
20	688019	安集科技	129,263,391.16	0.25

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	7,884,190,055.14
卖出股票的收入（成交）总额	7,836,042,250.87

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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）	59,996,051,615.13	99.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	59,996,051,615.13	99.29

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	38,099,990	4,384,625,136.68	7.26
2	113042	上银转债	18,321,910	2,116,557,082.69	3.50
3	113056	重银转债	10,705,350	1,333,618,243.04	2.21
4	110085	通 22 转债	11,091,120	1,241,720,773.25	2.06
5	132026	G 三峡 EB2	9,142,030	1,177,202,922.79	1.95

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。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。温氏食品集团股份有限公司在报告编制前一年受到新兴县新城镇人民政府的处罚。通威股份有限公司在报告编制前一年受到国家税务总局成都市税务局第三稽查局的处罚。重庆银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行万州分行、国家外汇管理局重庆市分局、重庆金融监管局的处罚。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	3,557,975.85
2	应收清算款	264,494,245.91
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	268,112,714.39

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	4,384,625,136.68	7.26
2	113042	上银转债	2,116,557,082.69	3.50
3	113056	重银转债	1,333,618,243.04	2.21
4	110085	通 22 转债	1,241,720,773.25	2.06
5	132026	G 三峡 EB2	1,177,202,922.79	1.95
6	127045	牧原转债	1,030,657,603.57	1.71
7	127089	晶澳转债	1,012,526,797.64	1.68
8	118034	晶能转债	884,855,660.78	1.46
9	127049	希望转 2	815,029,518.66	1.35
10	123107	温氏转债	792,688,457.12	1.31
11	110073	国投转债	781,521,491.42	1.29
12	113053	隆 22 转债	770,269,344.65	1.27
13	113062	常银转债	703,616,741.68	1.16
14	118031	天 23 转债	657,678,755.88	1.09
15	123176	精测转 2	637,068,989.48	1.05
16	118030	睿创转债	625,025,609.39	1.03
17	113691	和邦转债	605,723,511.72	1.00
18	127110	广核转债	599,615,409.48	0.99
19	110075	南航转债	594,217,657.42	0.98
20	118058	微导转债	593,858,725.02	0.98
21	127056	中特转债	545,391,812.63	0.90
22	127030	盛虹转债	534,576,699.19	0.88
23	127083	山路转债	515,762,824.15	0.85
24	123158	宙邦转债	498,460,341.25	0.82
25	110099	福能转债	496,351,822.30	0.82
26	128129	青农转债	493,215,289.28	0.82
27	123255	鼎龙转债	472,589,541.66	0.78
28	113043	财通转债	455,295,572.90	0.75
29	113037	紫银转债	450,213,778.18	0.75
30	127040	国泰转债	446,843,913.90	0.74
31	110081	闻泰转债	443,838,731.71	0.73
32	113059	福莱转债	442,746,675.15	0.73
33	123247	万凯转债	410,855,001.90	0.68

34	127067	恒逸转 2	399,973,385.62	0.66
35	113661	福 22 转债	391,878,660.56	0.65
36	128136	立讯转债	389,714,740.15	0.64
37	113677	华懋转债	378,042,631.65	0.63
38	118024	冠宇转债	370,551,757.17	0.61
39	113697	应流转债	369,690,007.52	0.61
40	118022	锂科转债	352,154,663.33	0.58
41	113049	长汽转债	348,118,616.84	0.58
42	127108	太能转债	341,785,224.46	0.57
43	113067	燃 23 转债	340,074,808.78	0.56
44	113696	伯 25 转债	338,700,700.00	0.56
45	113051	节能转债	335,139,303.25	0.55
46	110087	天业转债	332,521,403.41	0.55
47	127070	大中转债	326,230,407.45	0.54
48	127084	柳工转 2	316,582,432.85	0.52
49	113699	金 25 转债	305,092,467.29	0.50
50	123241	欧通转债	303,601,690.76	0.50
51	127037	银轮转债	299,544,379.95	0.50
52	123259	锦浪转 02	291,560,835.49	0.48
53	113615	金诚转债	291,489,447.34	0.48
54	127085	韵达转债	272,402,150.33	0.45
55	127103	东南转债	267,202,097.77	0.44
56	123216	科顺转债	259,205,134.99	0.43
57	113054	绿动转债	259,119,266.16	0.43
58	118062	天准转债	253,126,336.13	0.42
59	113616	韦尔转债	251,943,265.18	0.42
60	113632	鹤 21 转债	248,127,517.12	0.41
61	127050	麒麟转债	243,266,812.90	0.40
62	110093	神马转债	242,077,168.85	0.40
63	118060	瑞可转债	235,234,158.28	0.39
64	123251	华医转债	229,592,598.45	0.38
65	118056	路维转债	228,759,987.89	0.38
66	127061	美锦转债	228,491,032.99	0.38
67	118051	皓元转债	223,615,064.20	0.37
68	113666	爱玛转债	223,582,082.17	0.37
69	113058	友发转债	220,816,660.38	0.37
70	110086	精工转债	219,023,561.63	0.36
71	123119	康泰转 2	219,014,400.80	0.36
72	113070	渝水转债	218,557,032.49	0.36
73	113655	欧 22 转债	214,946,996.69	0.36
74	118053	正帆转债	210,891,696.56	0.35
75	113682	益丰转债	205,347,561.95	0.34
76	118059	顾中转债	202,816,374.63	0.34
77	127027	能化转债	199,697,365.71	0.33

78	127096	泰坦转债	197,333,586.76	0.33
79	127038	国微转债	195,272,053.78	0.32
80	118013	道通转债	195,179,170.39	0.32
81	110090	爱迪转债	194,235,531.38	0.32
82	110076	华海转债	192,649,043.83	0.32
83	118050	航宇转债	190,330,444.53	0.31
84	113066	平煤转债	187,327,329.21	0.31
85	113048	晶科转债	186,184,758.91	0.31
86	113046	金田转债	185,312,259.55	0.31
87	123178	花园转债	180,414,519.85	0.30
88	113652	伟 22 转债	174,793,556.74	0.29
89	127025	冀东转债	172,036,727.96	0.28
90	128134	鸿路转债	171,604,775.82	0.28
91	113667	春 23 转债	171,044,394.13	0.28
92	113673	岱美转债	162,949,945.11	0.27
93	113692	保隆转债	161,785,753.25	0.27
94	127064	杭氧转债	160,827,872.17	0.27
95	113647	禾丰转债	157,338,049.26	0.26
96	111000	起帆转债	156,691,603.56	0.26
97	110095	双良转债	153,321,735.95	0.25
98	123257	安克转债	150,981,187.62	0.25
99	127111	金威转债	150,772,655.15	0.25
100	123258	胜蓝转 02	146,725,727.37	0.24
101	111018	华康转债	145,359,964.56	0.24
102	113605	大参转债	144,997,766.51	0.24
103	128135	洽洽转债	140,867,816.21	0.23
104	113659	莱克转债	140,635,030.09	0.23
105	127082	亚科转债	138,919,623.53	0.23
106	118042	奥维转债	138,102,109.28	0.23
107	118061	茂莱转债	138,026,071.93	0.23
108	123149	通裕转债	136,757,563.39	0.23
109	123150	九强转债	134,036,066.43	0.22
110	110098	南药转债	132,785,886.07	0.22
111	127046	百润转债	130,732,360.20	0.22
112	123253	永贵转债	125,522,763.72	0.21
113	127092	运机转债	124,667,171.83	0.21
114	113636	甬金转债	121,054,828.90	0.20
115	110097	天润转债	120,799,251.71	0.20
116	110077	洪城转债	117,801,052.56	0.19
117	123104	卫宁转债	113,398,734.45	0.19
118	113658	密卫转债	113,301,775.81	0.19
119	113633	科沃转债	112,987,581.07	0.19
120	127088	赫达转债	112,144,425.62	0.19
121	123165	回天转债	112,139,816.65	0.19

122	123263	鼎捷转债	110,196,395.61	0.18
123	123091	长海转债	109,495,973.12	0.18
124	127102	浙建转债	109,428,308.67	0.18
125	127031	洋丰转债	107,963,766.95	0.18
126	123114	三角转债	107,956,099.52	0.18
127	110084	贵燃转债	107,648,473.14	0.18
128	123113	仙乐转债	107,182,999.68	0.18
129	113640	苏利转债	106,615,959.28	0.18
130	123179	立高转债	105,806,241.04	0.18
131	123117	健帆转债	104,180,809.67	0.17
132	123252	银邦转债	103,174,301.07	0.17
133	123194	百洋转债	99,779,679.01	0.17
134	113688	国检转债	99,658,573.18	0.16
135	111021	奥锐转债	99,540,479.23	0.16
136	111024	澳弘转债	98,694,196.01	0.16
137	113648	巨星转债	98,143,243.02	0.16
138	113679	芯能转债	97,466,475.83	0.16
139	123215	铭利转债	97,121,406.57	0.16
140	127068	顺博转债	96,399,784.40	0.16
141	118011	银微转债	95,818,140.85	0.16
142	118005	天奈转债	94,816,785.35	0.16
143	123172	漱玉转债	94,746,461.53	0.16
144	113650	博 22 转债	93,481,778.40	0.15
145	123213	天源转债	93,340,423.22	0.15
146	127095	广泰转债	90,386,418.70	0.15
147	127105	龙星转债	89,532,237.88	0.15
148	113634	珀莱转债	85,452,963.61	0.14
149	113656	嘉诚转债	85,405,494.82	0.14
150	123133	佩蒂转债	84,861,657.85	0.14
151	113670	金 23 转债	84,645,254.86	0.14
152	127109	电化转债	84,417,455.76	0.14
153	113627	太平转债	83,454,665.28	0.14
154	123188	水羊转债	83,039,395.52	0.14
155	111002	特纸转债	82,894,929.46	0.14
156	123192	科思转债	81,822,161.11	0.14
157	123225	翔丰转债	80,549,186.48	0.13
158	123183	海顺转债	79,846,162.97	0.13
159	118032	建龙转债	79,541,247.65	0.13
160	123124	晶瑞转 2	78,358,203.98	0.13
161	123131	奥飞转债	77,173,697.22	0.13
162	111009	盛泰转债	76,847,007.97	0.13
163	123195	蓝晓转 02	76,843,411.98	0.13
164	123076	强力转债	76,551,885.96	0.13
165	111015	东亚转债	76,288,429.88	0.13

166	127104	姚记转债	76,163,762.00	0.13
167	111004	明新转债	75,236,590.68	0.12
168	128142	新乳转债	74,871,489.40	0.12
169	123151	康医转债	74,814,393.22	0.12
170	111017	蓝天转债	74,215,659.19	0.12
171	123071	天能转债	73,971,061.21	0.12
172	110074	精达转债	73,649,365.03	0.12
173	111022	锡振转债	72,828,883.59	0.12
174	113693	志邦转债	72,247,731.62	0.12
175	113631	皖天转债	72,187,212.81	0.12
176	113678	中贝转债	70,893,269.17	0.12
177	123122	富瀚转债	70,642,908.91	0.12
178	113681	镇洋转债	70,381,179.11	0.12
179	118044	赛特转债	70,086,248.50	0.12
180	123193	海能转债	69,274,200.38	0.11
181	118035	国力转债	68,761,528.54	0.11
182	128128	齐翔转 2	68,607,826.92	0.11
183	127060	湘佳转债	67,351,671.39	0.11
184	118012	微芯转债	66,387,243.24	0.11
185	113638	台 21 转债	66,230,772.69	0.11
186	111014	李子转债	66,078,393.02	0.11
187	123144	裕兴转债	65,891,933.62	0.11
188	118020	芳源转债	65,665,547.66	0.11
189	118040	宏微转债	65,609,797.02	0.11
190	123262	神宇转债	65,226,209.33	0.11
191	128121	宏川转债	64,709,589.60	0.11
192	127041	弘亚转债	64,335,607.53	0.11
193	113695	华辰转债	63,685,787.76	0.11
194	127047	帝欧转债	63,571,111.52	0.11
195	113625	江山转债	61,985,279.79	0.10
196	123142	申昊转债	61,598,684.15	0.10
197	123064	万孚转债	61,330,962.39	0.10
198	113643	风语转债	61,237,630.81	0.10
199	123243	严牌转债	59,342,468.71	0.10
200	123235	亿田转债	59,323,298.17	0.10
201	127069	小熊转债	58,834,476.63	0.10
202	123260	卓镁转债	58,389,942.71	0.10
203	127054	双箭转债	57,784,129.82	0.10
204	123109	昌红转债	57,587,724.85	0.10
205	113694	清源转债	56,955,854.27	0.09
206	123154	火星转债	56,593,202.47	0.09
207	123168	惠云转债	55,566,088.71	0.09
208	127099	盛航转债	55,541,617.54	0.09
209	127072	博实转债	55,255,352.53	0.09

210	118037	上声转债	54,856,548.26	0.09
211	113624	正川转债	54,387,909.45	0.09
212	123214	东宝转债	54,110,564.49	0.09
213	113649	丰山转债	53,600,863.64	0.09
214	127078	优彩转债	53,446,757.88	0.09
215	123237	佳禾转债	52,362,746.87	0.09
216	123245	集智转债	51,724,404.07	0.09
217	123090	三诺转债	51,449,027.34	0.09
218	127098	欧晶转债	51,165,877.67	0.08
219	123211	阳谷转债	50,839,999.04	0.08
220	118015	芯海转债	50,470,275.94	0.08
221	118039	煜邦转债	50,052,635.72	0.08
222	128138	侨银转债	49,890,867.53	0.08
223	118010	洁特转债	49,451,970.90	0.08
224	123118	惠城转债	48,599,396.91	0.08
225	127034	绿茵转债	48,512,211.09	0.08
226	118036	力合转债	48,509,953.44	0.08
227	113674	华设转债	46,655,974.81	0.08
228	127055	精装转债	46,507,370.97	0.08
229	123171	共同转债	46,427,605.94	0.08
230	113686	泰瑞转债	45,970,429.48	0.08
231	128125	华阳转债	45,956,330.26	0.08
232	118052	浩瀚转债	44,932,502.12	0.07
233	123187	超达转债	44,791,818.13	0.07
234	127053	豪美转债	44,282,100.81	0.07
235	127062	垒知转债	44,128,114.77	0.07
236	113660	寿 22 转债	44,011,907.88	0.07
237	123207	冠中转债	43,881,781.04	0.07
238	127059	永东转 2	43,734,500.82	0.07
239	123250	嘉益转债	43,593,746.49	0.07
240	111020	合顺转债	43,036,141.95	0.07
241	123155	中陆转债	42,297,243.10	0.07
242	113039	嘉泽转债	42,114,799.00	0.07
243	123199	山河转债	40,167,464.37	0.07
244	113680	丽岛转债	40,070,566.56	0.07
245	113698	凯众转债	39,568,784.50	0.07
246	113665	汇通转债	39,309,601.21	0.07
247	123196	正元转 02	39,271,986.96	0.06
248	123189	晓鸣转债	37,980,910.88	0.06
249	123180	浙矿转债	37,070,303.12	0.06
250	127044	蒙娜转债	36,991,654.44	0.06
251	123092	天壕转债	36,895,896.65	0.06
252	123175	百畅转债	36,831,496.27	0.06
253	123160	泰福转债	36,243,287.46	0.06

254	113671	武进转债	35,811,914.78	0.06
255	123224	宇邦转债	34,746,623.25	0.06
256	123222	博俊转债	34,347,231.53	0.06
257	123220	易瑞转债	33,796,281.99	0.06
258	118016	京源转债	33,596,061.37	0.06
259	118007	山石转债	32,968,583.64	0.05
260	123261	普联转债	32,267,806.55	0.05
261	123088	威唐转债	31,956,784.55	0.05
262	113597	佳力转债	31,944,659.95	0.05
263	111012	福新转债	29,286,020.13	0.05
264	123173	恒锋转债	28,989,942.14	0.05
265	123209	聚隆转债	28,786,841.48	0.05
266	123138	丝路转债	28,618,064.13	0.05
267	123157	科蓝转债	28,365,377.66	0.05
268	123112	万讯转债	27,745,873.42	0.05
269	127093	章鼓转债	26,968,671.03	0.04
270	111003	聚合转债	26,810,514.41	0.04
271	123065	宝莱转债	25,590,988.33	0.04
272	123223	九典转 02	25,500,064.02	0.04
273	128124	科华转债	22,388,601.33	0.04
274	123229	艾录转债	22,220,171.67	0.04
275	113646	永吉转债	20,269,447.59	0.03
276	123059	银信转债	18,077,074.58	0.03

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

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
16,657	259,403.65	4,246,718,273.00	98.28%	74,168,397.00	1.72%

8.2 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。

8.3 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	3,794,286,670.00
本报告期基金总申购份额	2,038,300,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,511,700,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,320,886,670.00

§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

基金管理人于 2026 年 02 月 14 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张东先生代任公司首席信息官，王德英先生离任公司副总经理、公司首席信息官。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期无涉及基金财产的诉讼。

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

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，基金管理人没有受到监管部门的调查或处罚。

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，基金管理人相关从业人员没有受到监管部门的调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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	
银河证券	2	1,290,313,346.22	16.47%	265,681.74	16.47%	增加 2 个
长江证券	2	-	-	-	-	-

华泰证券	2	392,364,696.77	5.01%	80,802.86	5.01%	增加 2 个
中信证券	2	1,869,247,332.91	23.85%	384,876.05	23.85%	增加 1 个
招商证券	5	2,363,164,742.10	30.16%	486,548.16	30.16%	增加 1 个
中金公司	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	增加 1 个
国泰海通	2	1,857,157,474.59	23.70%	382,400.80	23.70%	增加 1 个
德邦证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	增加 1 个
广发证券	2	63,794,658.28	0.81%	13,133.62	0.81%	增加 2 个

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序

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

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

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

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		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	33,080,818,977.64	49.43%	15,730,000,000.00	20.45%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

华泰证券	1,236,929,522.75	1.85%	5,340,000,000.00	6.94%	-	-
中信证券	3,653,723,980.79	5.46%	8,189,000,000.00	10.65%	-	-
招商证券	20,817,035,468.09	31.11%	21,155,000,000.00	27.50%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	7,310,702,276.78	10.92%	23,931,000,000.00	31.11%	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	266,248,035.84	0.40%	1,546,000,000.00	2.01%	-	-
广发证券	557,747,495.88	0.83%	1,037,000,000.00	1.35%	-	-

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	2026-06-26
2	博时基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-05-29
3	2025 年度博时基金以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-30
4	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 2026 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	2026-04-22
5	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兴证券为申购、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	2026-04-13
6	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（2025 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	2026-03-31
7	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	2026-03-31
8	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-26
9	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-14
10	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-20260124	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-24

11	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 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	2026-01-22
12	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	2026-01-14
13	博时基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-12

§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

二〇二六年八月三十一日